



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE CAMPINAS

Instituto de Economia

HO-235 – Econometria de Dados em Painel

Prof. Alexandre Gori Maia ([gori@unicamp.br](mailto:gori@unicamp.br)) – IE/UNICAMP

Prof. Marcelo Justus ([mjustus@unicamp.br](mailto:mjustus@unicamp.br)) – IE/UNICAMP

---

## PROGRAMA

### Ementa:

Disciplina de econometria aplicada à análise de dados em painel em programa estatístico (SAS, Stata, e R). Serão abordados os seguintes tópicos: (1) revisão de regressão múltipla; (2) análise de dados empilhados; (3) análise com dados em painel, estimação e inferência de modelos que consideram efeitos fixos e aleatórios para indivíduos e/ou tempo; (3) extensões de modelos e métodos de estimação com dados em painel: modelos de primeira diferença (avaliação de impactos), variáveis instrumentais e modelos dinâmicos.

**Carga horária:** 60 h

**Aulas:** de 10 a 19 de julho de 2017 – Sala SPD1

**Horário:** 8h30 às 12h30 e das 14h às 18h

### Programa

- 1 Introdução ao Stata e revisão de regressão linear
  - a. Manipulação de base de dados em programa estatístico (SAS, Stata e R)
  - b. Regressão múltipla e estimadores de MQO
  - c. Análise da qualidade do ajuste
  - d. Viés de especificação
  
- 2 Introdução à análise de dados em painel
  - a. Modelos com dados empilhados
  - b. Efeitos fixos e efeitos aleatórios
  - c. Coeficientes angulares interativos
  - d. Estimadores robustos e MQG (Heterocedasticidade e Autocorrelação)
  
- 3 Extensões da análise com dados em painel
  - a. Modelos de primeira diferença
  - b. Estimação com variáveis instrumentais
  - c. Estimadores para painel dinâmico: Arellano-Bond, Arellano-Bover/Blundell-Bond

### Objetivos

O objetivo do curso é apresentar conceitos fundamentais da análise de regressão e orientar o aluno no desenvolvimento de pesquisas que envolvam a análise de dados em painel, apresentando seus principais fundamentos e aplicações.

### Metodologia

Aulas expositivas com aplicações dos conceitos apresentados através de exercícios em programa estatístico SAS, Stata e R.

### Avaliação

Elaboração de trabalho final com análises de resultados de um ajuste de regressão com dados em painel (ou dados empilhados) sobre tema de interesse do aluno. O conceito final considerará a qualidade do trabalho e participação em sala de aula.

*Formato do trabalho:*

- Entre 10 a 15 páginas, fonte Times New Roman, tamanho 12, espaçamento 1,5 entre linhas.
- Tabelas com fonte Times New Roman, tamanho 10 a 12 (não copiar como imagem), título numerado no cabeçalho, rodapé contendo fonte dos dados;

*Estrutura do trabalho:*

- Introdução: descrevendo justificativa do estudo, objetivo e breve descrição do método de análise e apresentação dos resultados;
- Método de análise: descrevendo fonte dos dados, variáveis, transformações, modelo econométrico e técnica de análise;
- Resultados: apresentando e descrevendo principais resultados e limitações das análises econométricas;
- Considerações finais: discussão das principais conclusões do trabalho.
- Bibliografia: artigos, livros e documentos utilizados incluídos como referências no texto.

**Referências básicas**

BALTAGI, B. H. **Econometric analysis of Panel Data**. 2nd edition, John Wiley & Sons. 2002.

BAUM, C. F. **An introduction to modern econometrics using Stata**. Stata Press, 2006.

CAMERON. A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics using Stata**. Stata Press, 2009.

HSIAO, C. **Analysis of Panel Data**. Cambridge University Press, 2003.

MAIA, A. G. **Econometria**. Instituto de Economia, 2015 (mimeo).

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of Cross Section and Panel Data**. 2nd edition. Massachusetts. The MIT Press. 2007.