



EC00931 – Tópicos Especiais em Econometria/Dados de Paine

CH: 60 horas/aula

Créditos: 04

Docente: Tatiane Almeida de Menezes

Objetivo

O objetivo desse curso é a apresentação dos principais métodos econométricos aplicados a microdados. O foco do curso será tanto teórico como prático de forma a dar ao aluno experiência no manejo das principais bases de dados brasileiras, assim como familiarização com os principais pacotes de softwares econométricos existentes. Para tanto, o curso está dividido em duas partes. A primeira parte faz uma apresentação teórica dos métodos econométricos e sua interpretação. A segunda parte está voltada para aplicações práticas de tais métodos utilizando as bases de dados brasileiras.

Programa

1. Introdução
2. Inferência Causal
3. O Método de Variáveis Instrumentais e Dados em Paine
4. O Modelo de Seleção de Heckman, O Efeito Marginal do Tratamento e o Efeito sobre os Não-Tratados.
5. Amostra Estratificada e Cluster

Método de Avaliação

A avaliação será composta por: apresentação de trabalhos e 1 provas.

Nota Final: [Prova1 + Trabalho] / 2

Referências Bibliográficas

Bibliografia Básica

Cameron C. e Trivedi, P. *Microeconometrics: Theor y and Application*, Cambriedge University Press, 2005.

Wooldridge,Jeffry “*Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data*”, MIT Press, 2002.

Bibliografia Complementar:

1. Introdução

Heckman, J. 2001. Micro Data, Heterogeneity, and the Evaluation of Public Policy. *Journal of Political Economy*, v. 109, n. 4. Primeira Parte.

Angrist, J and Krueger, A (1999). “Empirical Strategies in Labour Economics”, in *Handbook of Labour Economics*, Vol. 3, cap 23.

Lisboa e Menezes-Filho (2001) *Microeconomia e Sociedade*. Editora Contra-Capa

2. Inferência Causal

Cox, D. R. (1992), "Causality: Some Statistical Aspects." *Journal of the Royal Statistical Society, Series A*, 155, part 2, 291-301.

Heckman, J. (2008), "Econometric Causality." *IZA Discussion Paper Series n. 3425*.

- Heckman, J. (2005). The scientific model of causality. Unpublished manuscript, University of Chicago, Department of Economics.
- Heckman, J. (2001). Micro Data, Heterogeneity, and the Evaluation of Public Policy. *Journal of Political Economy*, v. 109, n. 4.
- Holland, P., (1986), "Statistics and Causal Inference,"(with discussion), *Journal of the American Statistical Association*, 81, 945-970.
- Imbens, G. and Wooldridge, J. (2008), "Recent Developments in the Econometrics of Program Evaluation," NBER WP 14251.
- Rubin, D. 1974. Estimating Causal Effects of Treatments in Randomized and Non-randomized Studies. *Journal of Educational Psychology*, 66, 688-701

3. O Método de Variáveis Instrumentais e Dados em Painel

- Abadie, A. (2003), "Semiparametric Instrumental Variable Estimation of Treatment Response Models," *Journal of Econometrics*, vol. 113, 231-263.
- Angrist, J., G. W. Imbens and D. Rubin, (1996), "Identification of Causal Effects Using Instrumental Variables," (with discussion) *Journal of the American Statistical Association* vol 91, no 434, 444-472.
- Angrist, J. D. (1990), "Lifetime Earnings and the Vietnam Era Draft Lottery: Evidence from Social Security Administrative Records," *American Economic Review*, vol. 80, 313-336.
- Angrist J. D. and A. Krueger (1991), "Does Compulsory School Attendance Affect Schooling and Earnings?," *Quarterly Journal of Economics*, vol. 106, 979-1014.
- Angrist, J. 2004. Treatment Effect Heterogeneity in Theory and Practice. *Economic Journal*. 114: C52-C83.
- Imbens, G. W. & J. D. Angrist. (1994). Identification and estimation of local average treatment effects. *Econometrica*, 62, 467-475.
- Islam (1997) "Growth Empirics : A Panel Data Approach". *Quarterly Journal of Economics*, vol. 110, 1127-1170.
- Browning, Deaton e Irish. (1985). "A Profitable Approach to Labor Supply and Commodity Demands over the Life Cycle". *Econometrica*, vol. 59 503-44.
- Blundel, Duncan e Meghir "Estimation of Labor Supply Responses using Tax Reforms" *Econometrica*, 66, 4, 1998.
- Levitt (1997) "Using Electoral Cycles in Police Hiring to Estimate the Effect of Police on Crime". *American Economic Review*, 87.
- Arellano e Bond (1991). "Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo, Evidence and an Application to Employment Equations", *Review of Economic Studies*, vol. 58.
- Terra, M. C. "Credit Constraints in Brazilian Firms: Evidence from Panel Data" *Revista Brasileira de Economia*, vol. 57, no. 2, pp. 443-464, 2003.
- Angrist (1991). "Grouped -Data Estimation and Testing in Simple Labor Supply Models". *Journal of Econometrics*, vol. 47 , 243-266.
- Moffit (1993). "Identification and Estimation of Dynamic Models with a Time Series of Repeated Cross-Sections". *Journal of Econometrics*, vol. 59, 99-123.

4. O Modelo de Seleção de Heckman, O Efeito Marginal do Tratamento e o Efeito sobre os Não-Tratados.

- Heckman, J. 2005. The scientific model of causality. Unpublished manuscript, University of Chicago, Department of Economics.
- Heckman, J. 2001. Micro Data, Heterogeneity, and the Evaluation of Public Policy. *Journal of Political Economy*, v. 109, n. 4. Segunda Parte.
- Heckman, James J. 1979. Sample Selection Bias as a Specification Error. *Econometrica*. 47(1): 153-161.



Heckman, J. and E. Vytlačil 2005. Structural Equations, Treatment Effects and Econometric Policy Evaluation. *Econometrica*. 73(3), 669- 738.

5. Amostra Estratificada e Cluster

Deaton, A. (1997), *The Analysis of Household Surveys: A Microeconomic Approach to Development Policy*, Baltimore, Johns Hopkins Press.

Bryk, A. S., and S. W. Raudenbush (1992, 2002), *Hierarchical Linear Models*, Newberry Park, Sage Publications.