
Nome da Disciplina: Econometria de Dados em Painel

Código: ECN958 – Tópicos especiais em Mét. Quantitativos

Carga horária: 30 horas/aula

Créditos: 2

Curso: Ciências Econômicas

Pré-requisito: Econometria I

Período Letivo: 1º Semestre de 2024

Horários: 09:20 – 12:50 (quinta-feira)

Professor: Rafael S. M. Ribeiro (rsmribeiro@cedeplar.ufmg.br)

EMENTA

Modelos de dados em painel com T curto e regressores estritamente exógenos: Efeitos Fixos e Efeitos Aleatórios; Modelos de dados em painel dinâmicos com T curto: Método de Momentos Generalizados em Diferenças e em Sistemas.

Os softwares econométricos utilizados são o STATA e o R.

PROGRAMA

1) MODELOS DE DADOS EM PAINEL COM REGRESSORES ESTRITAMENTE EXÓGENOS

Baum, cap. 4, 9.1; Wooldridge, cap. 13 e 14; Greene, cap. 13; Pesaran, cap. 26.

2) MODELOS DINÂMICOS COM T CURTO:

Baum, cap. 4, 9.2 e 9.3; Greene, cap. 10.4, 11.3, 12.7, 13.6, 14.4, 15.5, 15.6 e 18; Pesaran, cap. 27.

BIBLIOGRAFIA

BAUM, C. F. (2006) An introduction to modern econometrics using Stata. Stata Press. GREENE, W. (2000). Econometric Analysis (4th edn). Upper Saddle River, NJ: Prentice Hall. HSIAO, C. (2014). Analysis of panel data (3rd edn). Cambridge: Cambridge University Press.

PESARAN, M.H. (2015). Time series and panel data econometrics. Oxford: Oxford University Press.

WOOLDRIDGE, J. M. (2002). Introdução à Econometria: uma abordagem moderna (2a edição). São Paulo: Thomson Learning.

WOOLDRIDGE, J. M. (2010). Econometric analysis of cross section and panel data (2nd edn). Cambridge, MA. USA: The MIT Press.

AVALIAÇÃO

A avaliação do curso consistirá na apresentação um seminário e duas entregas de trabalhos.

Seminário: 40 pontos

Entrega de trabalhos: 60 pontos

CRONOGRAMA

Horas	Data	Dia	Tema
4	07/mar	qui	Introdução
8	14/mar	qui	Dados empilhados
12	21/mar	qui	Efeitos fixos
16	28/mar	qui	Efeitos aleatórios
20	04/abr	qui	GMM-Diff
24	11/abr	qui	GMM-Sys
28	18/abr	qui	Local projections
28	25/abr	qui	
32	02/mai	qui	Apresentações