DISCIPLINA: Tópico Especial: Análise Econométrica de Dados em Painel	**CÓDIGO**: PPGA0050
PROFESSOR: Lucélia Viviane Vaz Raad	

Nível	Mestrado
Caráter	Não obrigatória
Carga Horária	45
Créditos	3
Área de Concentração	Processos e Sistemas Decisórios
Linha de Pesquisa	Processos e Sistemas Decisórios em Arranjos Organizacionais

Ementa

Modelos lineares para dados em painel. Modelo de efeitos fixos. Modelo de efeitos aleatórios. Heteroscedasticidade. Autocorrelação. Estimação robusta. Endogeneidade. Variáveis instrumentais. Estimação pelo método de momentos generalizados – GMM. Regressões aparentemente não relacionadas – SUR. Modelos dinâmicos de dados em painel. Estacionariedade em dados de painel. Modelos de dados em painel com variável dependente binária: modelos probit e logit. Aplicação em tomada de decisão dos consumidores e organizações.

Objetivo

Entender o comportamento dos agentes para subsídio à tomada de decisão dos consumidores, empresas e governo. Analisar dados associados aos indivíduos utilizando métodos de regressão próprios para dados de painel. A partir das técnicas listadas na ementa, os alunos poderão identificar a mais adequada para tratar os dados (previamente selecionados).

Interdisciplinaridade

Pré-requisitos	**Código**
Não tem	
Disciplinas para as quais é pré-requisito	
Não tem	

Unidades de ensino		Carga-horária Horas
1	Modelos estruturais, exogeneidade, dados para experimentos sociais, variáveis instrumentais, modelos de equações estruturais.	8
2	1 - "Pooled models"; 2 - modelos de efeitos fixos; 3 - modelos de efeitos aleatórios.	14
3	Modelos SUR	5
4	Modelos dinâmicos de dados em painel. Não-estacionariedade de dados de painel.	14
5	Modelos de dados em painel com variável dependente binária: modelos probit e logit	4
	Total	**45**

Bibliografia	
1	CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics:** methods and applications. Cambridge: Cambridge University Press, 2005.
2	WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. Cambridge: MIT Press, 2010.
3	ARELLANO, M. **Panel data econometrics**. New York: Oxford University Press, 2003.
4	MONTES, G. C.; BASTOS, J. C. A.; DE OLIVEIRA, A. J. **Fiscal transparency, government effectiveness and government spending efficiency**: Some international evidence based on panel data approach. Economic Modelling, v. 79, p. 211-225, 2019.
5	SCRIPTORE, J. S.; AZZONI, C. R.; MENEZES FILHO, N. A. Os Impactos Do Saneamento Básico Sobre A Educação: Usando A Privatização Como Variável Instrumental. Rio de Janeiro, dez. 2018. **46º Encontro Nacional de Economia**. Disponível em: https://www.anpec.org.br/encontro/2018/submissao/files_I/i10-8a330b78c09d0b456ce116d1d893df4d.pdf. Acesso em: 08 abr. 2021.
6	MEIRELES, D. C.; DA SILVA FREGUGLIA, R.; CORSEUIL, C. H. L. Discriminação por gênero e poder de mercado. Natal, dez. 2017. **45º Encontro Nacional de Economia**. Disponível em: https://www.anpec.org.br/encontro/2018/submissao/files_I/i13-7e6aa7380de0fccc6b8e8882eda5fe54.pdf. Acesso em: 08 abr. 2021.
7	OLIVEIRA, F. S.; JUSTUS, M. Evidências do efeito negativo da depressão nos rendimentos das mulheres no Brasil: uma abordagem de variável instrumental. Natal, dez. 2017. **45º Encontro Nacional de Economia**. Disponível em: https://www.anpec.org.br/encontro/2017/submissao/files_I/i13-d6c2ec83ba76aedf4351ab00560a6df4.pdf. Acesso em: 08 abr. 2021.
8	GONZAGA, G.; REIS, M. C. Oferta de trabalho e ciclo econômico: os efeitos trabalhador adicional e desalento no Brasil. **Revista Brasileira de Economia**, v. 65, n. 2, p. 127-148, 2011.
9	Luz, G.; Barboza, M. H.; da Silva Portugal, L.; Giannotti, M.; van Wee, B. Does better accessibility help to reduce social exclusion? Evidence from the City of São Paulo, Brazil. **SocArXiv**. February, 19, 2022.