**Econometria II - REC 2312 1º Semestre, 2017**

**Prof. Daniel Domingues dos Santos**

1. **Objetivos**

- Lidar com o problema de endogeneidade do resíduo em modelos lineares

(Modelos do tipo y = **Xβ** + ε onde E[ε | **X**] não é constante)

- Lidar com variáveis endógenas binárias em alguns modelos não-lineares

(Modelos do tipo y = μ(**X**,ε), onde y é uma variável binária)

1. **Conteúdo**

- *Variáveis Instrumentais (VI)*

\* Experimentos controlados e experimentos naturais

\* VI e regressões lineares múltiplas

\* Estimador de Mínimos Quadrados em 2 Estágios (MQ2E) e inferência em VI

\* Equações simultâneas

*- Dados longitudinais (painel)*

\* Variação longitudinal e estimação de efeitos causais

\* Estimadores de efeitos fixos e primeiras diferenças

\* Estimador de efeitos aleatórios

\* Inferência

*- Variável dependente binária*

\* Motivação: dificuldades no uso de regressões lineares

\* Modelos de utilidade aleatória: Probit e Logit

\* (se houver tempo) Modelos censurados e truncados: Tobit e Heckit

1. **Avaliação**

- 2 provas.

\* Nota = (P1+2P2)/3

\* P1: 23/04

\* P2: 02/07

1. **Referências**

\* Notas de aula (EAD)

\* Wooldridge, J. *Introdução à Econometria*, caps. 13-17