



**Programa Econometria II**  
REC 2312 - 1º Semestre 2015  
Docente: Daniel Domingues dos Santos

1. Objetivos

- Lidar com problemas de endogeneidade do resíduo em modelos lineares (Modelos do tipo  $y = \mathbf{X}\beta + \epsilon$  onde  $E[\epsilon|\mathbf{X}]$  não é constante)
- Lidar com variáveis endógenas binárias em alguns modelos não-lineares (Modelos do tipo  $y = \mu(\mathbf{X}, \epsilon)$ , onde  $y$  é uma variável binária)

2. Conteúdo

- (a) Variáveis Instrumentais (VI)
  - i. Experimentos controlados e experimentos naturais
  - ii. VI e regressões lineares múltiplas
  - iii. Estimador de Mínimos Quadrados em 2 Estágios (MQ2E) e inferência em VI
  - iv. Equações simultâneas
- (b) Dados Longitudinais (painel)
  - i. Variação Longitudinal e estimação de efeitos causais

- ii. Estimadores de efeitos fixos e primeiras diferenças
- iii. Estimador de Efeitos Aleatórios
- iv. Inferências

(c) Variável dependente binária

- i. Motivação: dificuldades no uso de regressores lineares
- ii. Modelos de utilidade aleatória: Probit e Logit
- iii. Modelos censurados e truncados: Tobit e Heckit - (caso haja tempo)

3. Avaliação

- 2 provas: P1 - 27/04 (1/3 da nota) e P2 - 29/06 (2/3 da nota)

4. Referências

- Notas de aula (EAD)
- Wooldridge, J. Introdução à Econometria, caps. 13-17