**Econometria II - REC 2312 1º Semestre, 2018**

**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**

- Exercícios em sala (frequência aproximadamente semanal).

 \* Nota = média das 50% melhores notas nos exercícios

1. **Referências**

\* Notas de aula (EAD)

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