Exemplo 15.1 (Wooldridge) Retorno da educação para mulheres casadas

Arquivo MROZ.DTA

Nós só queremos analisar mulheres com valores observados de salário, por isso extraímos inicialmente um subconjunto dos nossos dados

Estimar o retorno da educação para as mulheres

Fazer a regressão do log(salário) na educação

Usar a educação do pai como VI para educação

Testar se educação do pai é um bom instrumento para VI. Não está no script, mas é muito fácil de fazer.

Exemplo 15.3 (Wooldridge) Estimação do efeito do hábito de fumar sobre o peso do nascimento

Arquivo BWGHT.DTA

Regredir o log do peso ao nascer na quantidade de maços de cigarro que a mãe fuma usando MQO

Por que maços de cigarro que a mãe fuma pode ser uma variável endógena?

O preço médio dos cigarros no estado em que a mulher reside é uma boa VI para a quantidade de maços de cigarro?

O que aconteceria se fosse usado VI ao invés de MQO?

Exemplo 15.4 (Wooldrige) Utilizando a proximidade da faculdade como VI de educação

Arquivo CARD. DTA

Amostra de homens em 1976

Dmmy igual a 1 se o homem cresceu perto de uma faculdade com cursos de graduação de 4 anos (nearc4) como VI

Controles: dummy para raça, dummy para residir em área metropolitana, dummy para residir no sul, dummies regionais, dummy por residir em área metropolitana em 1966

Verificar se nearc4 é uma boa VI para educação

Regredir log(salário) em educ, exper, exper ^2 e todos os controles listados acima usando MQO

Repetir a regressão acima, mas usando VI

Exemplo 15.5 (Wooldridge) Retorno da educação para mulheres que trabalham

Arquivo MROZ.DTA

Agora temos dois instrumentos: a educação dos pais e a educação das mães

Deve-se fazer a regressão de log(salário) em educação, experiência e experiência ao quadrado

Obter as estimativas de MQ2E de dois jeitos:

1. Fazer os dois estágios “manualmente”, incluindo educação ajustada no primeiro estágio como regressor na equação do segundo estágio
2. Usar a estimação automática de MQ2E

Não está no script o teste de validade dos dois instrumentos. Você consegue fazer isso? Os instrumentos são válidos?

Exemplo 15.7 (Wooldridge) Retorno da educação para mulheres que trabalham

Fazer o teste de Hausman “manualmente”, ou seja, o teste de regressão

Fazer o teste de Hausman automaticamente

Quebra-cabeça :Você recebeu várias estimações relacionadas à seguinte regressão:

$$lnEarn\_{i}=β\_{1}+β\_{2}S\_{i}+β\_{3}Wexp\_{i}+β\_{4}Gender\_{i}+β\_{5}EthBlack\_{i}+β\_{6}Ethhisp\_{i}+u\_{i}$$

Onde

lnEarn=log dos salários por hora em $

S = anos de escolaridade

Wexp = experiência em anos

Gender =1 se mulher e 0 de outra forma

Ethblack = 1 se negro e 0 de outra forma

Ethhisp = 1 se hispânico e 0 de outra forma

Essas estimações podem ser vistas como peças num quebra-cabeça. Você deve, então, montar esse quebra-cabeça de tal forma que ele resulte num trabalho empírico lógico e consistente. Ao contrário dos quebra-cabeças com os quais a gente está acostumado você não precisa usar todas as peças