



Microeconometria usando o R

Vítor Wilher

1 Ementa do Curso

O objetivo do Curso de *Microeconometria usando o R* é capacitar alunos de graduação e pós-graduação, professores e profissionais de mercado em econometria aplicada a microdados. O curso envolve tanto a apresentação teórica de modelos de regressão, quanto a aplicação no R de diversos exemplos associados a dados de corte transversal, séries de tempo e dados em painel. Espera-se que ao final do Curso o aluno tenha facilidade em desenvolver trabalhos empíricos empregando microdados.¹

2 Programa Detalhado

1. Relações causais e análises *ceteris paribus*;
2. Tipos de estruturas de dados;
3. Regressão Linear Simples para dados de corte transversal: introdução, análise de variância, estimação pontual e por intervalos, previsão e testes de hipóteses;
4. Regressão Linear Múltipla para dados de corte transversal: introdução, dummies, comparação de modelos, modelos parcialmente lineares, fatores, interações e mínimos quadrados ponderados;
5. Regressão Linear para séries temporais;
6. Regressão Linear para dados em painel;
7. Sistemas de equações lineares;
8. Testes e Diagnósticos;
9. Variáveis Instrumentais;
10. Regressão Resistente;
11. Regressão Quantílica;
12. Modelos Lineares Generalizados;
13. Variáveis dependentes binárias: regressões logit e probit;
14. Modelos de regressão para dados de contagem;
15. Variáveis Dependentes Censuradas

¹O curso é baseado, essencialmente em Kleiber and Zeileis (2008), Wooldridge (2002), Stock and Watson (2007) e em papers acadêmicos selecionados pelo professor.

16. Um modelo de resposta binária semiparamétrico;
17. Modelos de resposta multinomial;
18. Modelos de resposta ordenada;
19. Modelos de regressão com descontinuidade (RDD).
20. Microdados: análise de dados da RAIS e da PNAD;

Referências

- Kleiber, C., and A. Zeileis. 2008. *Applied Econometrics with R*. Springer.
- Stock, J. H., and M. W. Watson. 2007. *Introduction to Econometrics*. Pearson Education.
- Wooldridge, J. M. 2002. *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. The MIT Press.