



LISBON
SCHOOL OF
ECONOMICS &
MANAGEMENT
UNIVERSIDADE DE LISBOA

U LISBOA

UNIVERSIDADE
DE LISBOA

MICROECONOMETRIA II

MESTRADO EM ECONOMETRIA APLICADA E PREVISÃO (Ano Lectivo 2019/2020)

Docente: Esmeralda A. Ramalho, ISEG/UL (eramalho@iseg.ulisboa.pt)

OBJECTIVOS

Esta unidade curricular tem como principal objectivo complementar os conhecimentos adquiridos no âmbito da unidade de Microeconometria I mediante o estudo de uma selecção de tópicos que, juntamente com os já abordados anteriormente, permite cobrir de forma sistemática a modelação dos principais tipos de dados microeconómicos. Para cada um dos tópicos abordados, pretende-se que o aluno domine as principais especificações alternativas, os métodos de estimação mais relevantes e os pressupostos que lhes estão associados e um conjunto de testes de especificação que permita avaliar a adequabilidade dos pressupostos assumidos.

Paralelamente, a Microeconometria II tem como objectivo promover o contacto com trabalhos de investigação teórica e aplicada no âmbito dos tópicos abordados e assegurar que o aluno domine um conjunto de estratégias que lhe permitam, de uma forma rigorosa, realizar estudos de natureza teórica e/ou empírica, utilizando o software adequado, quando relevante. No final do semestre o aluno deverá também estar habilitado a dominar de forma independente outras metodologias e técnicas não lecionadas e saber avaliar criticamente estudos empíricos existentes com dados microeconómicos.

PROGRAMA

- Estimação e inferência em modelos não lineares: estimadores extremum, da máxima verosimilhança e do método dos momentos generalizado. Análise de especificação em modelos não lineares. Dados de painel em modelos não lineares
- Modelos para variável dependente de contagem ou positiva
- Modelos para variável dependente fraccionária
- Modelos para variável dependente truncada, censurada, com excesso de zero ou com estratificação endógena
- Modelos para variável dependente de duração
- Regressão de quantis

METODOLOGIA

A metodologia de ensino adoptada consiste na formação presencial, sempre em sala de computação. Consiste essencialmente na exposição de conteúdos teóricos, acompanhada de exemplos práticos e ilustrada pela via da exploração de conjuntos de dados reais com recurso ao software STATA

AVALIAÇÃO DE CONHECIMENTOS

A avaliação da UC em **Época Normal** é constituída por **1 Trabalhos/Estudo de Caso**, realizado por grupos de 3 a 4 alunos, e por uma prova escrita individual, realizada com consulta de material de apoio em formato papel. A ponderação de cada um dos dois elementos de avaliação é de 50% e a nota mínima admissível em cada um deles é de 7 valores.

A avaliação da UC em **Época de Recurso** é constituída por um Exame Escrito (ponderação de 100%).

TRABALHO DE GRUPO/ESTUDO DE CASO (formato de artigo, sem ultrapassar as 15 páginas de texto + anexo contendo os outputs relevantes) – apresentação prévia a 21 de Outubro, apresentação final a 9 de Dezembro e entrega a 13 de Dezembro

- Definição do problema e escolha das variáveis (justificação económica da escolha) e modelos potencialmente apropriados
- Breve revisão da literatura sobre o tema
- Apresentação dos dados e sua descrição
- Análise econométrica: especificação, estimação e análise de especificação do(s) modelo(s) e interpretação económica
- Conclusão: contribuições para o problema formulado limitações do estudo e linhas de investigação a explorar futuramente

BIBLIOGRAFIA BASE

Cameron A.C. e Trivedi P.K. (2005), *Microeconometrics, Methods and Applications*, Cambridge University Press.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

Newey, W. K. e D. McFadden, 1994, Large sample estimation and hypothesis testing, in: R.F. Engle e D.L. McFadden, eds., *Handbook of Econometrics*, Vol. IV (Elsevier Science) 2113-2245.

Ramalho, E.A., Ramalho, J.J.S. & Murteira, J.M.R. “Alternative estimating and testing empirical strategies for fractional regression models”, *Journal of Economic Surveys*, 25(1), 19-68.

Wooldridge, J.M. (2010). *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, 2nd Edition, MIT Press.

Verbeek, M. (2012). *A Guide to Modern Econometrics*, John Wiley & Sons, 4th Edition