



LISBON  
SCHOOL OF  
ECONOMICS &  
MANAGEMENT  
UNIVERSIDADE DE LISBOA

U LISBOA

UNIVERSIDADE  
DE LISBOA

## MICROECONOMETRIA II

### MESTRADO EM ECONOMETRIA APLICADA E PREVISÃO (Ano Lectivo 2020/2021)

**Docente:** Esmeralda A. Ramalho, ISEG/UL ([eramalho@iseg.ulisboa.pt](mailto: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 26 de Outubro, apresentação final a 14 de Dezembro e entrega a 16 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

## PLANIFICAÇÃO

Sessão	Data	Tópicos
1	14/9	Estimação e inferência em modelos não lineares: estimadores extremum, da máxima verosimilhança e do método dos momentos generalizado. Análise de especificação. Modelos não lineares para dados de painel
2	21/9	Modelos para variável dependente de contagem ou positiva: dados seccionais. Ilustração
3	28/9	Modelos para variável dependente de contagem ou positiva: dados de painel e endogeneidade. Ilustração
4	12/10	Modelos para variável dependente fraccionária: dados seccionais. Ilustração
5	19/10	Modelos para variável dependente fraccionária: dados de painel e endogeneidade. Ilustração
6	26/10	Apresentação do trabalho inicial nos projectos empíricos. Algum enquadramento teórico, esquema metodológico e estatística descritiva dos dados
7	02/11	Variáveis dependentes truncadas ou censuradas. Modelo Tobit. Modelos a Duas Partes. Ilustração
8	09/11	Modelos para amostra com selecção. Estratificação exógena e endógena. Modelos para amostras de estratificação endógena. Ilustração
9	16/11	Modelos para variável dependente de duração. Ilustração
10	23/11	Modelos para variável dependente de duração em presença de heterogeneidade. Ilustração
11	30/11	Regressão de quantis. Ilustração
12	7/12	Regressão de quantis para variável dependente de contagem. Ilustração
13	14/12	Apresentação e discussão dos projectos empíricos
		Prova de Avaliação
		Exame de Recurso