



Universidade do Minho
Escola de Economia e Gestão

NIPE

Núcleo de Investigação em
Políticas Económicas

II Curso de Verão

Dynamic Panel Data Analysis

Frank Windmeijer

The Institute for Fiscal Studies, University College of London

30 de Junho e 01 de Julho de 2005

Quinta-Feira, 30 de Junho

10.00 - 10.30	Registo e recepção da documentação
10.30 - 12.30	Instrumental variables, GMM Fixed effects/random effects Computer practical
12.30 - 14.00	Almoço
14.00 - 16.00	Dynamic Panel Data Model Arellano-Bond GMM estimation Computer practical
16.00 - 16.30	Intervalo
16.30 - 18.00	Arellano-Bond GMM estimation - continued Computer practical

Sexta-Feira, 1 de Julho

09.00 - 11.00	Weak instruments Blundell-Bond GMM estimation Computer practical
11.00 - 11.15	Intervalo
11.15 - 12.30	Finite sample inference
12.30 - 14.00	Almoço
14.00 - 16.00	Identification, unit root tests Computer practical
16.00 - 16.30	Intervalo
16.30 - 18.00	Generalised Empirical Likelihood estimation

:: Sala 2.30 da Escola de Economia e Gestão - Universidade do Minho - Campus de Gualtar - Braga ::

Apoios:

FCT Fundação para a Ciência e a Tecnologia



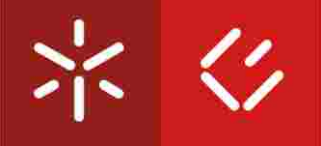
Fundação Calouste Gulbenkian

Organização:

NIPE

Núcleo de Investigação em Políticas Económicas

<http://www.eeg.uminho.pt/economia/nipe>



Universidade do Minho
Escola de Economia e Gestão

NIPE

Núcleo de Investigação em
Políticas Económicas

Informações adicionais:

Valor da inscrição:

- 125 € até 31 de Maio
- 150 € após 31 de Maio

A inscrição inclui:

- Curso;
- Material de apoio;
- 2 Refeições em regime de Buffet;
- Senhas para café.

As vagas serão preenchidas de acordo a recepção das candidaturas e com os interesses dos candidatos.

O curso será leccionado em Inglês.

Após a frequência do curso os alunos receberão um Certificado de Frequência.

Ficha de Inscrição

Nome:			
Habilitações:			
Profissão:		Instituição:	
Áreas de Investigação:			
Endereço:			
Código Postal:		Localidade:	
Telefone:		E-Mail:	
Assinatura:			

Valor da inscrição: ☐ 125 € (até 31 de Maio)
☐ 150 € (após 31 de Maio)

Junto envio cheque nº:		Banco:	
Data:			
Recibo em nome de:		Nº de contribuinte:	
Morada:			
Código Postal:		Localidade:	

Contactos:

Natália Pimenta Monteiro (Organizadora)
Tel.: +351 253 604 539
Fax: +351 253 676 375
e-Mail: n.monteiro@eeg.uminho.pt

Endereço para envio de inscrições:

NIPE
Escola de Economia e Gestão
Universidade do Minho - Campus de Gualtar
4710-057 Braga



Bibliografia recomendada:

Livros:

- Hsiao, C. (2002), Analysis of Panel Data, 2nd Edition, Econometric .
- Society Monographs, Cambridge University Press.
- Baltagi, B.H. (2002), Econometric Analysis of Panel Data, 2nd Edition, Wiley.
- Wooldridge, J.M. (2002), Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, The MIT Press.
- Arellano, M. (2002), Panel Data Econometrics, Oxford University Press.
- Lee, M.J. (2002), Panel Data Econometrics. Methods of Moments and Limited Dependent Variables, Academic Press.

Artigos de revisão:

- M. Arellano and B.E. Honoré, 2001, Panel Data Models: Some Recent Developments, in J.J. Heckman and E. Leamer (eds.) Handbook of Econometrics V, Chapter 53, pp. 3229-3296.
- Chamberlain, G., Panel Data, in Z. Griliches and M.D. Intriligator (eds.) Handbook of Econometrics II, Chapter 22, pp. 1247-1318.

Artigos recomendados para o curso:

- Bond, S.R., 2002, Dynamic Panel Data Models: A Guide to Microdata Methods and Practice, Portuguese Economic Journal 1, 141-162.
- Blundell, R.W., S.R. Bond and F. Windmeijer, 2000, Estimation in Dynamic Panel Data Models: Improving on the Performance of the Standard GMM Estimator', in B. Baltagi (ed.), Nonstationary Panels, Panel Cointegration, and Dynamic Panels, Advances in Econometrics 15, Amsterdam: JAI Press, Elsevier Science.
- Bond S.R., and F. Windmeijer, 2005, Reliable Inference for GMM Estimators? Finite Sample Properties of Alternative Test Procedures in Linear Panel Data Models, Econometric Reviews 24, 1-37.
- Windmeijer, F., 2005, A Finite Sample Correction for the Variance of Linear Efficient Two-Step GMM Estimators', Journal of Econometrics 126, 25-51.
- Bond, S.R., C.Nauges and F.Windmeijer, 2005, Unit Roots and Identification in Autoregressive Panel Data Models: A Comparison of Alternative Tests. <http://econpapers.repec.org/paper/cpdpd2002/c5-4.htm>

Contactos:

Natália Pimenta Monteiro (Organizadora)
Tel.: +351 253 604 539
Fax: +351 253 676 375
e-Mail: n.monteiro@eeg.uminho.pt

Endereço para envio de inscrições:

NIPE
Escola de Economia e Gestão
Universidade do Minho - Campus de Gualtar
4710-057 Braga