

Program letní školy – Analýza a zpracování ekonomických dat

Provozně ekonomická fakulta Mendelovy univerzity v Brně

29. 8. – 1. 9. 2017

Datum	Obsah přednášky (9:00 – 11:30)	Obsah semináře (12:30 – 15:00)
ÚT 29.8.	Práce s Evropskými statistickými daty (Marie Bohatá) <ul style="list-style-type: none">• Evropský statistický systém (ESS) a jeho hlavní atributy• Statistický systém centrálních bank a koordinace s ESS• Tvorba celosvětových a evropských statistických standardů• Srovnatelnost, včasnost a další aspekty kvality evropských statistik• Diseminace evropských statistik a přístup k mikrodatům	Zpracování firemního datového souboru (Martin Guzi) <ul style="list-style-type: none">• Transformace panelových dat• Práce s chybějícími a odlehlými pozorováními• Struktura datového souboru (popisné statistiky, korelační matice)• Práce s daty, která nejsou normálně rozložena
ST 30.8.	Úvod do problematiky identifikačních metod ve firemních financích (Jan Hanousek) <ul style="list-style-type: none">• Klasifikace experimentů• Úvod do identifikačních strategií• Definice a použití kontrolních skupin v quasi experimentech	Aplikace 1: Párování a testy v quasi experimentech (p-score matching) (Martin Guzi) <ul style="list-style-type: none">• Výpočty a párování v quasi experimentech• Metoda pravděpodobnostních skóre (P-score matching) a její implementace ve STATA
ČT 31.8.	Rozdíly v rozdílech (Difference-in-difference), párování v quasi exper. (Jan Hanousek) <ul style="list-style-type: none">• Použití různých algoritmů na vytváření kontrolních skupin a výpočty rozdílů v rozdílech• Endogenní metody (přepínací pravidla)• Zajímavá použití kontrolních skupin	Aplikace 2: Identifikace pomocí endogenních vazeb, práce s kontrolními skupinami, testy (Martin Guzi) <ul style="list-style-type: none">• Endogenní přepínací pravidlo použité na identifikaci finančních omezení, případně na šedou ekonomiku• Procvičení různých možností v párování• Testy kvality párování
Pá 1.9.	Identifikace informací pomocí spojování datových souborů (Jan Hanousek) <ul style="list-style-type: none">• Výhody rozdílných informačních zdrojů k identifikaci významných informací• Spojování/kombinace datových souborů• Heckmanova korekce a FE	Aplikace 3: Spojení mikroekonomických datových souborů pro analýzu efektivity firem (Martin Guzi) <ul style="list-style-type: none">• Různé metody spojování souborů• Práce s klastry, vytváření vlastnických struktur pro AMADEUS• Různé definice a práce s chybějícími pozorováními• Heckmanova korekce v panelových datech.

Doporučená literatura, která bude diskutována na seminářích:

30.8.

- Lemmon, M. L., Roberts, M. R., Zender, J. F., 2008. Back to the beginning: persistence and the cross-section of corporate capital structure. *The Journal of Finance* 63, 1575-1608.
- Hanousek, J., Shamshur, A., 2011. A stubborn persistence: Is the stability of leverage ratios determined by the stability of the economy? *Journal of Corporate Finance*, 17, 5, 1360-1376.

31.8.

- Caliendo, M., & Kopeinig, S. (2008). Some practical guidance for the implementation of propensity score matching. *Journal of Economic Surveys*, 22, 31–72.
- Diamond, Alexis, and Jasjeet S. Sekhon (2013). "Genetic matching for estimating causal effects: A general multivariate matching method for achieving balance in observational studies." *Review of Economics and Statistics* 95.3: 932-945.
- Nargiza Alimukhamedova, Randall K. Filer, and Jan Hanousek 2017. The Importance of Geographic Access for the Impact of Microfinance. *Development Policy Review*, DOI: 10.1111/dpr.12248
- Lichard, Tomáš, Hanousek, Jan, and Filer, Randall K., 2015. "Measuring the Shadow Economy: Endogenous Switching Regression with Unobserved Separation," *CEPR Discussion Papers* 10483, C.E.P.R. Discussion Papers.

1.9.

- Hanousek, Jan & Kochanova, Anna, 2016. Bribery Environment and Firm Performance: Evidence from Central and Eastern European Countries, *European Journal of Political Economy*, Volume 43, June 2016, Pages 14-28.
- Jan Hanousek, Anastasiya Shamshur and Jiri Tressl 2015. Is Bread Gained by Deceit Sweet to a Man? Corruption and Firm Efficiency. Centre for Economic Policy Research, *CEPR Discussion Papers* 10951, C.E.P.R. Discussion Papers.
- Jan Hanousek, Anastasiya Shamshur and Jiri Tressl 2017. To bribe or not to bribe? Corruption uncertainty and corporate practices, *CERGE-EI mimeo*, forthcoming in *C.E.P.R. Discussion Papers*.
- Wooldridge, J. (1995). Selection Corrections for Panel Data Models under Conditional Mean Independence Assumptions. *Journal of Econometrics*. 68, pp. 115-132.