

Formation :

Modélisation des Données de PANEL avec STATA

Objectifs :

Ce séminaire de formation s'adresse à des personnes qui souhaiteraient approfondir leurs

connaissances dans le domaine de l'économétrie des données de panel. Le but de ce séminaire est de proposer une initiation, tant sur le plan théorique que sur le plan appliqué, à l'économétrie des données de panel. Sur le plan théorique, le séminaire débutera par une petite initiation sur le logiciel STATA, suivie par la présentation des problèmes de spécifications de base en économétrie de panel et par les méthodes d'estimation traditionnelles : Effet fixe, Les modèles avec effets aléatoires et les estimateurs MCG, MCQG et VI (variables instrumentales) ainsi que l'estimateur de Hausman-Taylor en cas de présence de variables explicatives invariantes dans le temps.

Durée : 1 demi-journée

Niveau : Intermédiaire

Public cible : ce séminaire de formation s'adresse aux doctorants, aux étudiants de mastères, chercheurs et professionnels souhaitant acquérir rapidement la maîtrise d'utilisation du logiciel STATA et l'autonomie nécessaire pour réaliser des travaux portant sur l'analyse des données de panel.

Pré-requis : Savoir utiliser un micro-ordinateur sous Windows ainsi que MS Excel. Avoir une initiation au logiciel STATA. Connaissances de base en économétrie (estimation, tests, violation des hypothèses classiques) (MCO, GMM, VI, MCG...), les tests de racine unitaire, etc.

Programme :

- **Panel 1 : Modèle linéaire en panel statique (théorique)**
 - o Les tests de spécification (homogénéité vs hétérogénéité)
 - o Les modèles avec effets fixes (individuels et temporels), et les estimateurs within et LSDV.
 - o Les modèles avec effets aléatoires et les estimateurs MCG, MCQG et VI (variables instrumentales) ainsi que l'estimateur de Hausman-Taylor en cas de présence de variables explicatives invariantes dans le temps.

- Les différents tests de significativité des effets individuels fixes ou aléatoires (Test de Fisher et test du multiplicateur de Lagrange –test LM-).
- Les comparaisons entre les différents estimateurs (convergence, consistance et efficacité) et le modèle préféré
-
- **Panel 1 : Modèle linéaire en panel statique (pratique)**
 - Créer un panel avec STATA
 - Structurer et décrire un panel
 - Analyse statistique
 - Estimation : les différentes méthodes
 - Choix de la méthode à mettre en œuvre
 - Interprétation des résultats
 - Tests d'hypothèses et de diagnostic de résidu.