

Analyse statistique des données de panels

Lieu de la formation : CIQSS, 3535 chemin Queen-Mary, bureau 420, Montréal

Dates : 30 mai au 3 juin 2016

Objectif

L'objectif du cours est de présenter les estimateurs linéaires et non-linéaires couramment utilisés en sciences sociales, particulièrement en économie, en présence de données longitudinales de panels (mesures répétées).

Contenu

Méthodes d'estimation avec panels

Ce cours présente les estimateurs linéaires et non-linéaires utilisés en présence de données de panels ; le progiciel Stata qui permet leur utilisation ; les tests d'hypothèses particuliers qui s'appliquent dans ces contextes et quelques exemples d'applications.

Seront vus:

- I.1 les modèles avec effets aléatoires et l'estimateur des moindres carrés généralisés
- I.2 les modèles avec effets fixes
- I.3 les modèles en différence première
- I.4 les comparaisons entre ces estimateurs
- I.5 les modèles avec choix binaire (Probit, Logit avec effets fixes et aléatoires)
- I.6 les modèles avec choix multiples
- I.7 Le calcul des effets de variables explicatives sur les probabilités en I.5 et I.6 (en anglais marginal effects).

Formateur

Philip Merrigan est professeur titulaire au département des sciences économiques de l'Université du Québec à Montréal (UQAM). Ses recherches portent sur l'offre de travail des familles, la démographie et l'économétrie des données longitudinales et transversales.

Déroulement et méthode

Ce cours se donnera en français de **9 h 15 à 17 h**. Le programme de chaque journée est divisé en deux volets. Le premier, en matinée, porte sur des notions théoriques. On y présente certains problèmes conceptuels ou méthodologiques et les solutions qui ont été proposées pour les contourner. L'après-midi est consacré à une session pratique au cours de laquelle les participants auront à utiliser les outils présentés en matinée à l'aide de données d'enquête.

Plan de cours

Jour 1

- Modèles linéaires ordinaires et en contexte longitudinal: effets aléatoires et effets fixes.

Jour 2

- Estimateurs en première différence et tests de spécifications (Woolridge, 2002).

Jour 3

Modèles non linéaires: probit et logit avec effets aléatoires (Woolridge, 2003).

Jour 4

Modèles non linéaires: Logit ordonné et logit Multinomial

Jour 5

- Calcul des effets marginaux les modèles vus en jour 3 et jours 4.

Références bibliographiques

Angrist, Joshua and Alan Krueger (1999) "Empirical Strategies in Labor Economics," in Orley Ashenfelter und David Card, eds. *Handbook of Labor Economics Volume 3A*. Amsterdam: North-Holland. 1277-1366.

Greene, William H. (2003). *Econometric Analysis, fifth edition*. Upper Saddle River NJ: Prentice Hall.

Wooldridge, Jeffrey M. (2010). *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. Boston MA: The MIT Press.