

Analyse statistique des données de panels

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

Dates : 1^{er} au 5 juin 2009

Cette session de formation bénéficie de l'appui financier du Conseil de recherche en sciences humaines du Canada, du Fonds québécois de la recherche sur la société et la culture ainsi que des universités-membres du CIQSS¹.

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:

- 1.1 les modèles avec effets aléatoires et l'estimateur des moindres carrés généralisés
- 1.2 les modèles avec effets fixes
- 1.3 les modèles en différence première
- 1.4 les comparaisons entre ces estimateurs
- 1.5 les modèles avec choix binaire (Probit, Logit avec effets fixes et aléatoires)
- 1.6 les modèles avec choix multiples
- 1.7 le modèle avec biais de sélection à cause de l'échantillon (Tobit avec effets fixes et aléatoires)
- 1.8 les cas de variables explicatives endogènes

Déroulement

Ce cours se donnera en français de **9 h 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 (Wooldridge, 2002).

¹ Université de Montréal, INRS-UCS, Université McGill, Université Concordia, Université Laval, Université du Québec à Montréal, Université de Sherbrooke.

Jour 3 :

- Autocorrélation et hétéroscédasticité;

Jour 4 :

- Modèles non linéaires: probit et logit avec effets aléatoires (Wooldridge, 2002).

Jour 5 :

Tobit et biais de sélection

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. (2002). *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. Boston MA: The MIT Press.

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 du travail de la famille, la démographie et l'économétrie des données longitudinales et transversales.

Profil des participants

Ce séminaire s'adresse aux étudiants gradués, aux chercheurs du milieu universitaire (professeurs, agents de recherche, chercheurs postdoctoraux) et gouvernemental œuvrant dans le domaine de l'évaluation et de l'élaboration des politiques publiques. Les participants devront être familiers avec les modèles de régression et l'inférence statistique et avoir une connaissance pratique d'un logiciel d'analyse statistique tel SAS, STATA ou SPSS. Il ne s'agit pas d'un cours d'introduction. On acceptera un maximum de quinze participants et ceux-ci seront sélectionnés en fonction de la pertinence du cours pour leur programme d'étude ou leurs activités professionnelles.

Information

La période d'inscription s'étendra du **2 au 27 mars 2009**. L'annonce des résultats de la sélection des participants sera faite au cours de la semaine du **30 mars 2009**. Pour toute autre information et pour vous inscrire, vous êtes invité à consulter notre site internet : www.ciqss.umontreal.ca.

Pour plus d'informations

Luc St-Pierre

Centre interuniversitaire québécois de statistiques sociales

Université de Montréal

C.P. 6128, Succursale Centre-ville

Montréal, Québec H3C 3J7

Téléphone : (514) 343-2090, poste 3 / Télécopieur : (514) 343-2328

Courriel: l.st-pierre@umontreal.ca