



I dati panel contengono informazioni su molte osservazioni *cross-sectional*, rilevate a intervalli di tempo regolari. I dati panel hanno utilizzo sempre più diffuso in econometria, analisi finanziaria, medicina e scienze sociali per tre principali motivi: consentono un adeguato trattamento di varie forme di eterogeneità latente tra gli individui; possono migliorare notevolmente la precisione delle stime; infine, consentono di sottoporre ad analisi empirica modelli economici realistici, con dinamica di breve e lungo periodo.

Il workshop intende fornire ai partecipanti la strumentazione teorica e applicata necessaria per: i) poter svolgere autonomamente analisi empiriche con le tecniche panel più recenti e avanzate, e ii) capire e valutare gli studi basati sui dati panel riportati nella letteratura accademica e professionale. Il corso si concentra sulle metodologie utilizzate per l'analisi dei: i) panel stazionari: in particolare, modelli a effetti fissi e casuali, test per le violazioni delle ipotesi standard del modello di regressione; ii) panel dinamici, l'utilizzo dei quali si è diffuso per la loro capacità di tener conto degli effetti di breve e di lungo periodo e dell'eterogeneità latente tra diversi individui e iii) cenni alle tecniche per panel non-stazionari, sempre più utilizzate con la crescente disponibilità di long macro panel. Il corso si conclude con cenni ai modelli di dati panel non-lineari e ai modelli utilizzati per l'analisi di fenomeni le cui osservazioni possono assumere valori all'interno di intervalli specifici, quali decisioni di investimento o la decisione del numero di ore lavorative.

DESTINATARI. Il corso è di interesse per ricercatori e analisti in economia, medicina e scienze sociali che desiderino acquisire gli strumenti necessari per condurre ricerche empiriche utilizzando i dati panel dinamici.

Requisiti richiesti: Familiarità con il software Stata e conoscenze di base di econometria e/o statistica

DOMANDA DI PARTECIPAZIONE: La domanda di partecipazione dovrà essere effettuata tramite il modulo di registrazione, disponibile presso la segreteria organizzativa, che dovrà essere inviato a corsi@tstat.it entro il **25.08.2016**. Le domande saranno valutate sulla base dell'ordine d'iscrizione.

AMMISSIONE E QUOTA DI ISCRIZIONE: Il Workshop è limitato ad un numero massimo di 15 iscritti. La partecipazione è subordinata al pagamento delle seguenti tasse di iscrizione:

	STUDENTI DOTTORANDI	SPECIALIZZANDI ASSEGNIATI DI RICERCA	RICERCATORI ACCADEMICI	COMMERCIALI
Iscrizione anticipata entro il 28/06/2016 pagamento all'iscrizione	€ 468,00	€ 655,00	€ 842,00	€ 1.122,00
Iscrizione dopo il 28/06/2016 pagamento entro la data di inizio	€ 550,00	€ 770,00	€ 990,00	€ 1.320,00

Tutti i prezzi sono IVA esclusa. L'aliquota IVA non sarà applicata ai soggetti esenti IVA a norma dell'art. 14 c. 10 della L. 537/93 per la partecipazione a corsi di formazione. La quota di iscrizione include materiale didattico, una licenza temporanea del Software Stata 14 della durata di 30 giorni, pranzo e pausa caffè. A tutti gli iscritti sarà inoltre riservata una riduzione del 20% su una selezione di testi editi dalla StataPress e del 20% sull'acquisto di una Licenza per singolo utente di Stata 14 annuale e/o perpetua (ad esclusione della versione GradPlan).

MATERIALE DIDATTICO: Il materiale didattico include le dispense, i *do-file* e le banche dati per l'implementazione di tutte le applicazioni empiriche.

PROGRAMMA

INTRODUZIONE

Il software: Stata

Il modello classico di regressione lineare

Benefici dei dati panel per l'analisi econometrica

MODELLI LINEARI PER DATI PANEL CON VARIABILI STRETTAMENTE ESOGENE

Il modello di regressione a effetti "fissi" (-xtreg, fe-)

Il modello di regressione a effetti "random" (-xtreg, re-)

Tests di specificazione: Effetti "fissi" o effetti "random"?

Stima robusta degli standard error

MODELLI LINEARI PER DATI PANEL CON VARIABILI PREDETERMINATE ED ENDOGENE

Modelli statici (ivreg, xtivreg, xthtaylor ivreg2, xtivreg2)

Modelli dinamici: Stimatori IV e GMM (xtabond, xtdpd, xtdpdsys, simulate, gmm, xtabondz, abar)

Modelli dinamici: Stimatori LSDV corretti (xtlsdvc)

Panel non-stazionari e cointegrazione in Stata (xtunitroot, xtwest, xtpmg)

MODELLI PANEL NON-LINEARI

Preliminari

Modelli **logit**, **probit** e **tobit** con eterogeneità latente (xtlogit, xtprobit, xttobit)

Modelli non-lineari multivariati con eterogeneità latente (cmp, mvprobit)

Modelli panel con sample selection

Per ulteriori informazioni **CONTATTARE**

Monica Gianni | TStat S.r.l.

Via Rettangolo 12-14 | 67039 Sulmona AQ

Tel. 0864 210101 | Fax 0864 206014

www.tstat.it | e-mail corsi@tstat.it