

ANALISI DEI DATI PANEL CON STATA

OBBIETTIVO DEL CORSO

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; 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 workshop 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 programma 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.

In linea con la nostra filosofia di formazione, le sessioni teoriche sono affiancate da illustrazioni pratiche ed esempi provenienti da diverse discipline sia sociali che biomediche, in cui il docente chiarisce le limitazioni e i

punti di forza di ogni metodologia, nonché i criteri per la scelta e l'implementazione dello strumento di analisi statistica più appropriato per il problema oggetto di studio.

DESTINATARI

Il workshop 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.

PROGRAMMA

SESSIONE I: INTRODUZIONE

1. Il software Stata
2. Il modello classico di regressione lineare
3. Benefici dei dati panel per l'analisi econometrica

SESSIONE II: MODELLI LINEARI PER DATI PANEL CON VARIABILI STRETTAMENTE ESOGENE

1. Il modello di regressione a effetti "fissi" (*-xtreg, fe-*)
2. Il modello di regressione a effetti "random" (*-xtreg, re-*)
3. Tests di specificazione: Effetti "fissi" o effetti "random"?
4. Stima robusta degli *standard error*

SESSIONE III: MODELLI LINEARI PER DATI PANEL CON VARIABILI PREDETERMINATE ED ENDOGENE

1. Modelli statici (*ivreg, xtivreg, xthtaylor ivreg2, xtivreg2*)
2. Modelli dinamici: Stimatori IV e GMM (*xtabond, xtdpd, xtdpdsys, simulate, gmm, xtabond2, abar*)
3. Modelli dinamici: Stimatori LSDV corretti (*xtlsdvc*)
4. Panel non-stazionari e cointegrazione in Stata (*xtunitroot, xtwest, xtpmg*)

SESSIONE IV: MODELLI PANEL NON-LINEARI

1. Preliminari
2. Modelli *logit*, *probit* e *tobit* con eterogeneità latente (*xtlogit*, *xtprobit*, *xttobit*)
3. Modelli non-lineari multivariati con eterogeneità latente (*cmp*, *mvprobit*)
4. Modelli panel con *sample selection*

TESTI UTILI

- Panel Data Econometrics Advanced Texts in Econometrics (2003) di M. Arellano, Oxford University Press
- Microeconometrics using Stata, Revised Edition, (2010) di A. C. Cameron e P. K. Trivedi, Stata Press
- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data (2010) di J. Wooldridge, MIT Press

DATA E ISCRIZIONE

Il workshop è previsto a Milano il 6-7-8 Novembre 2017, dalle 9.00 alle 17.30.

La partecipazione è soggetta al pagamento della seguente quota di iscrizione:

Studenti*: € 788,00
Università: € 1314,00
Governo / No-Profit: € 1478,00
Commerciale: € 1643,00

*Per usufruire dello status "studente" è necessario presentare copia del libretto universitario o un certificato di iscrizione (in carta semplice) all'Università ed essere *studenti a tempo pieno*.

I prezzi si intendono IVA 22% esclusa. L'aliquota IVA non sarà applicata per Enti Pubblici soggetti ad esenzione a norma dell'art. 14 c. 10 della L. 537/93 per la partecipazione a corsi di formazione dei propri dipendenti.

La quota di iscrizione include il pranzo, il materiale didattico

e una licenza temporanea del software Stata (valida 30 giorni dalla data di inizio corso).

La partecipazione al workshop dà inoltre diritto ad uno sconto sull'acquisto di una nuova licenza per singolo utente del Software Stata (ad esclusione della versione GradPlan) e sull'acquisto di testi in Catalogo editi Stata Press.

L'iscrizione dovrà avvenire tramite lo specifico modulo di registrazione e pervenire a TStat S.r.l. entro il 22 Ottobre 2017.

Lo svolgimento è condizionato dal raggiungimento di un numero minimo di 8 partecipanti ed un numero massimo di 15.

PER ULTERIORI INFORMAZIONI RIVOLGERSI A:

Monica Gianni

Via Rettangolo, 12-14 | 67039 Sulmona (AQ)
Tel. 0864 210101 | Fax 0864 206014
formazione@tstat.it | www.tstat.it