



WORKSHOP

## ANALISI DEI DATI PANEL IN STATA

Milano, 2-4 Luglio 2018

### CODICE WORKSHOP

I-WS12

### DATA E LUOGO

Milano, 2-4 Luglio 2018

### REQUISITI RICHIESTI

Familiarità con il software Stata e conoscenze di base di econometria e/o statistica.

#### SESSIONE I: INTRODUZIONE

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 “Analisi dei dati Panel in Stata” offre ai partecipanti pertanto gli strumenti, sia teorici sia applicati, necessari 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*.

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. Dopo aver frequentato il workshop, il partecipante sarà in grado di implementare autonomamente le metodologie utilizzate durante il corso nel proprio specifico contesto di ricerca.

### DESTINATARI

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

### PROGRAMMA

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

## ANALISI DEI DATI PANEL IN STATA

### 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*

## QUOTA DI ISCRIZIONE

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

Studente\*: € 790.00

Assegnista / Specializzando: € 1050.00

Università: € 1310.00

Commerciale: € 1645.00

\*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*. Studenti lavoratori dovranno considerare la tariffa Assegnisti / Specializzandi.

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 (si consiglia di venire muniti del proprio computer o di chiedere informazioni alla segreteria per l'eventuale noleggio, al momento dell'iscrizione). Dà inoltre diritto ad uno sconto sull'acquisto di una nuova licenza per singolo utente del Software Stata (ad esclusione della versione per Studenti) e sull'acquisto di testi in catalogo Stata Press.

L'iscrizione al corso dovrà avvenire tramite lo specifico modulo di registrazione e pervenire a TStat S.r.l. entro il 12 Giugno 2018. Lo svolgimento è condizionato dal raggiungimento di un numero minimo di 8 partecipanti ed un numero massimo di 15.

Ulteriori informazioni sulla modalità di iscrizione, incluso termini e condizioni di partecipazione sono disponibili nel nostro sito alla pagina <https://www.tstat.it/formazione/analisi-dati-panel-stata/>

## 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

## CONTATTI

### Monica Gianni

TStat S.r.l. | Via Rettangolo, 12-14  
I-67039 Sulmona (AQ)  
T. +39 0864 210101

TStat Training | Kleebergstraße, 8  
D-60322 Frankfurt am Main

[formazione@tstat.it](mailto:formazione@tstat.it)

[www.tstat.it](http://www.tstat.it)

[www.tstattraining.eu](http://www.tstattraining.eu)

The logo for TStat, featuring a large, stylized red 'T' followed by the word 'Stat' in a black, cursive script font.