

OBBIETTIVO DEL CORSO

Il Workshop Microeconometria con Stata offre ai partecipanti un'introduzione esaustiva alle principali metodologie utilizzate nell'analisi dei dati microeconomici.

Il Workshop approfondisce, sia dal punto di vista teorico, sia da quello applicato, le seguenti metodologie: modelli con variabili strumentali, minimi quadrati nonlineari, modelli con variabili dipendenti binarie, modelli multinomiali, modelli Tobit e modelli di selezione, modelli di count data. Benché il titolo del corso faccia specificamente riferimento alla microeconometria, le tecniche illustrate sono utilizzate in tutte le scienze sociali, nonché in biostatistica ed epidemiologia.

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 rivolto a ricercatori e analisti provenienti da biostatistica, economia, epidemiologia, finanza, psicologia, scienze politiche, sociologia che vogliano acquisire le competenze statistiche per effettuare analisi empiriche autonomamente su micro dati.

REQUISITI RICHIESTI

Conoscenza di base di econometria/statistica e del Software Stata.

PROGRAMMA

SESSIONE I: NOZIONI PRELIMINARI

1. Stata 15 – Cenni
2. Modelli lineari e non-lineari in Econometria
3. Stimatori e test di specificazione per modelli lineari in presenza di variabili endogene: Stimatori IV e GMM (*ivregress*, *ivreg2*, *gmm*, *treatreg*)
4. Stimatori e test di specificazione per modelli non-lineari
5. Stima e interpretazione degli effetti marginali con *margins*

SESSION II: COUNT MODELS

1. Stimatori per modelli *count* in Stata: Il modello Poisson
 - Minimi quadrati non-lineari in Stata (*nl*), GMM (*gmm*), Maximum likelihood (*poisson*)
 - Regressori endogeni (*gmm* and *ivpoisson*)
2. Stima e test con *overdispersion*: regressione *negative binomial*: (*nbreg*, *gnbreg*)

SESSION III: MODELLI A VARIABILE DIPENDENTE DISCRETA

1. Modelli Univariati
 - Stimatori per modelli lineari a variabile dipendente binaria in Stata: Probit e Logit (*regress*, *probit*, *logit*)
 - Stimatori per modelli con categorie ordinate: (*oprobit*, *ologit*)
2. Modelli multivariati
 - modelli Probit bivariati e multivariati (*biprobit*, *mvprobit*, *cmp*)
 - modelli multinomiali
3. Eterogeneità individuale latente non correlata nei modelli Probit
 - Stima di *average partial effects* (APE)
4. Modelli Probit con regressori endogeni
 - L'approccio *control function* (CF) in presenza di regressori endogeni continui: stima e test
 - Stimatori *bootstrap* degli *standard errors* nell'approccio CF
 - Stima di massima verosimiglianza in presenza di regressori endogeni continui (*ivprobit*)
 - Lo stimatore probit multivariato recursivo come soluzione al problema dei regressori endogeni binari (*biprobit*, *mvprobit*, *cmp*)

SESSION IV: MODELLI PANEL PROBIT E LOGIT

1. Il problema dell'*incidental parameter* nei modelli nonlineari con eterogeneità individuale latente correlata
2. I modelli Panel Logit e Probit con eterogeneità individuale latente correlata
 - Modelli con eterogeneità individuale latente non correlata: modelli *random effect* (*xtlogit*, *xtprobit*)
 - Modelli con eterogeneità individuale latente correlata: modelli con effetti fissi
 - L'approccio Chamberlain-Mundlak ai modelli Probit
 - Il modello Logit con effetti fissi: (*xtlogit*)

SESSION V: MODELLI A VARIABILE DIPENDENTE CENSURATA E DI SAMPLE SELECTION

1. Stimatori per modelli a variabile dipendente censurata in Stata
2. Modelli Tobit: ML e *Two-step Least Squares* (*tobit*)
3. L'approccio CF in presenza di regressori endogeni continui: stima e test
4. Stima di massima verosimiglianza dei modelli Tobit con regressori endogeni: (*ivtobit*)
5. I modelli panel-data Tobit con eterogeneità latente
6. Stimatori per modelli di *Sample selection*
 - Test e correzioni a la Heckman per I modelli lineari
 - Test e correzioni per modelli panel lineari
 - Problemi di *attrition* nei modelli panel: *inverse probability weighting* (*IPW*)
 - Stimatori Bootstrap degli *standard errors* con *IPW*

TESTI UTILI

- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, Wooldridge, MIT Press (2010)
- Microeconometrics Using Stata, Cameron e Trivedi, StataPress (2009)
- Microeconometrics: Methods and Applications, Cameron e Trivedi, Cambridge University Press (2005)

DATA E ISCRIZIONE

Il workshop è previsto a Milano il 9-10-11 Ottobre 2017, dalle 9.00 alle 17.30.

La partecipazione al workshop 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 da 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 25 Settembre 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