



WORKSHOP MICROECONOMETRIA IN STATA

Milano, 3-5 Luglio 2019

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

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.

CODICE WORKSHOP

I-WS23

DATA E LUOGO

Milano, 3-5 Luglio 2019

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 – a quick review
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*

MICROECONOMETRIA IN STATA

SESSIONE 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*)
3. Modelli panel (*xtpoisson*)

SESSIONE 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 ricorsivo come soluzione al problema dei regressori endogeni binari (*biprobit*, *mvprobit*, *cmp*)
 - Modelli panel Probit e Logit (*xtrprobit*, *xtlogit*)
 - Modelli Probit e Logit a variabile dipendente frazionale (*fracreg*)

SESSIONE IV: INTRODUZIONE ALLA STIMA DI AVERAGE TREATMENT EFFECT

1. Il framework *Potential Outcome*
2. Stimatori Regression-adjustment (*regress*, *teffects ra*)
3. Stimatori Inverse-probability-weighting (*teffects ipw*)
4. Stimatori IPW RA (*teffects ipwra*)
5. Stimatori Propensity-score-matching (*teffects psmatch*)
6. Stimatori per modelli con treatment endogeno (*eteffects*, *etregress*, *etpoisson*)
7. Stimatori Diff-in-Diff (*regress con factor variables*, *diff*)

SESSIONE V: MODELLI A VARIABILE DIPENDENTE CENSURATA E DI SAMPLE SELECTION (TEMPO PERMETTENDO)

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
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



MICROECONOMETRIA IN STATA

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)

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 10 Giugno 2019. 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/microeconometria-stata/>

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

www.tstat.it

www.tstattraining.eu

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