



Association des Economistes Tunisiens

**SEMINAIRE DE FORMATION**

**ÉCONOMÉTRIE DES DONNÉES DE PANEL  
SOUS**

**STATA 10**

*Les 7 et 8 Juillet 2010*

*à l'Institut Supérieur de Finance et de Fiscalité de Sousse*

*ANIMÉ PAR*

**Ramzi Ben SLAMA**

**FORMATION  
PRATIOUE**



7 Juillet  
9h30-18h

Panels  
linéaires

Application sur  
données réelles

8 Juillet  
9h30-17h

Panels  
dynamiques

Application sur  
données réelles



**Pour s'inscrire contacter**

**Mounir Smida**

**Tel. 95 03 19 99**

**Email : [mounirsmida2003@yahoo.fr](mailto:mounirsmida2003@yahoo.fr)**

Les Places  
sont limitées

## **Séminaire de Formation en Econométrie des Données de Panel**

### **Objectif**

L'objectif de la formation est de présenter les estimateurs couramment utilisés dans les travaux de recherche en économie en présence de données de panel (mesures répétées). Nous nous concentrons tout particulièrement sur certaines problématiques économiques et sur la façon de les aborder de point de vue économétrique.

Cette formation se déroulera sur deux jours. Le programme de la journée est divisé en deux volets. Le premier, en matinée, porte sur des notions théoriques. On y présente certains problèmes conceptuels ou méthodologiques et les solutions qui ont été proposées pour les contourner. L'après-midi est consacré à une session pratique au cours de laquelle les participants auront à utiliser les outils présentés en matinée à l'aide de bases de données réelles.

### **Pré-requis**

Connaissances basiques en économétrie des données de panel

### **Public cible**

Ce séminaire de formation s'adresse aux doctorants et aux chercheurs ayant des travaux de recherche portant sur l'analyse des données de panel.

## Programme

Le séminaire de formation se déroule sur deux jours et, est organisé comme suit :

### - *Mercredi 7 juin 2010*

#### ***9H30-12H30 : Modèles linéaires en panel***

1. Les modèles avec effets fixes (individuels et temporels), et les estimateurs *within* et LSDV
2. Les modèles avec effets aléatoires et les estimateurs MCG, MCQG, MCG-Mundlak et VI (variables instrumentales) ainsi que l'estimateur de Hausman-Taylor en cas de présence de variables explicatives invariées dans le temps
3. Les différents tests de significativité des effets individuels fixes ou aléatoires (Test de Fisher et test du multiplicateur de Lagrange –test LM-)
4. Les comparaisons entre les différents estimateurs (convergence, consistance et efficacité) et le modèle préféré

#### ***14H-18H : Modèles linéaires en panel -Application***

1. Présentation du logiciel **STATA 10 SE** : commandes, importation et gestion des données, etc.
2. Généralités sur l'économétrie des données de panel avec stata
3. Application : programmation des estimateurs (within, MCG, MCQG, VI,...) et des tests (Fisher, LM, Hausman, Sargan, ...)
4. Interprétation et commentaire des résultats

### - *Jeudi 8 juin 2010*

#### ***9H30-12H30 : Modèles dynamiques en panel***

1. Le problème fondamental des panels dynamiques
2. Les méthodes d'estimation : VI (Anderson-Hsiao), GMM en différence (Arellano-Bond) et GMM en système (Blundell-Bond)
3. Les tests de corrélation sérielle d'ordre 1 et d'ordre 2 et les tests de validité des instruments de Sargan et de Hausman (*overidentification tests*)

#### ***14H00-17H00 : Modèles dynamiques en panel-Application***

1. Estimation de modèles de données de panel avec stata : les bases
2. Application : Programmation des estimateurs (Anderson-Hsiao, Arellano-Bond et Blundell-Bond) et des tests (corrélation sérielle, validité des instruments,...)
3. Interprétation et commentaire des résultats
4. Discussion