Errata - Séances 4 et 5

Pierre BEAUCORAL - Magistère 3

D'après le matériel de TD d'Ibrahim Goni ABDOULKADIRI

Séance 4 - Données de panel et effets fixes

- **Ex. 2.** Estimer aussi la spécification sans `age`.
- **Comparaison pooled / FE / RE (Ex. 2 et 4).** Les trois modèles doivent inclure les mêmes régresseurs, y compris `i.year` dans le modèle à effets aléatoires.
- **Ex. 4, Q2.** Compléter le test de Hausman par le test de Mundlak (effets aléatoires augmentés des moyennes individuelles, écarts types groupés, test joint des moyennes).

Séance 5 - Panel dynamique et GMM

- **Section 4.** `xtabond2` est un module SSC autonome (Roodman) : `ssc install xtabond2`. Il n'est pas fourni par `estout`.
- **Effets année.** Avec `L.lnhr`, l'échantillon commence en 1980 : utiliser `yr3`–`yr10` (référence 1980).
- **Ex. 4, Q3.** Toutes les spécifications proposées utilisent déjà `collapse`. Estimer aussi la GMM système sans `collapse` avec tous les retards disponibles, et comparer le nombre d'instruments, $\hat{\rho}$ et le test de Hansen.
- **Ex. 4, tableau d'audit.** Les statistiques demandées sont stockées par `xtabond2` : `e(j)` (instruments), `e(N_g)`, `e(ar1p)`, `e(ar2p)`, `e(hansenp)` ; `estimates table, stats(N N_g j ar1p ar2p hansenp)` les affiche.