

Econométrie linéaire des panels : une introduction.

Thierry MAGNAC

INRA, Université des Sciences Sociales & IDEI, Toulouse

On présente dans cet article les techniques économétriques utilisées pour estimer des modèles linéaires en utilisant des données individuelles et longitudinales, dites données de panel. On étudie d'abord les méthodes à effets individuels dans un cadre statique puis on expose les méthodes adaptées aux modèles dynamiques. On revient ensuite sur la construction des données pour montrer comment ces méthodes s'appliquent au cas où les données sont incomplètes et au cas des coupes transversales répétées. On ne traitera pas ici du cas des données qualitatives de panel.

Mots-clés : Données de panel, effets individuels, modèles dynamiques, pseudo-panels.
