

# Sur une nouvelle méthode instrumentale pour traiter des problèmes de sélection endogène

*Xavier d'HAULTFOEUILLE<sup>1</sup>*

Ce papier étudie une nouvelle méthode traitant de la sélection endogène, inspirée du calage généralisé de Deville (2001). Quand la sélection dépend directement de la variable d'intérêt, il peut être difficile d'exhiber un instrument influant la sélection mais pas directement la variable d'intérêt. Une autre stratégie instrumentale, basée sur l'indépendance entre les instruments et la sélection, est considérée ici.

Cette stratégie peut être particulièrement utile pour résoudre les problèmes de non-réponse non-ignorable, de modèles binaires avec covariables inobservées ou les modèles de Roy avec secteur inobservé.

L'identification non-paramétrique est obtenue sous l'hypothèse que la variable dépendante est une statistique complète pour l'instrument, une condition de rang récemment utilisée dans plusieurs problèmes non-paramétriques instrumentaux. Même si la relation d'exclusion est violée, l'approche développée ici permet d'obtenir des bornes optimales sur des paramètres d'intérêt, sous des conditions plus faibles de monotonie. Au-delà des résultats d'identification, l'estimation paramétrique et non-paramétrique est également considérée. Enfin, la méthode est appliquée à l'évaluation des effets du redoublement à l'école primaire en France.

---

<sup>1</sup> Dese, Insee - xavier.d'haultfoeuille@insee.fr