
Identification et Estimation des effets marginaux de traitement pour un Logit à effets fixes.

Laurent DAVEZIES (*), Xavier D'HAULTFÈUILLE (*), Louise LAAGE (**)

(*) ENSAE-CREST, Institut Polytechnique de Paris

(**) Georgetown University

laurent.davezies@ensae.fr

Mots-clés. Modèles Logit à effets fixes, données de panel, identification partielle.

Domaines. Econométrie Théorique.

Résumé

Cet article considère les effets marginaux moyens (AME) dans un modèle Logit à effets fixes de données de panel. En reliant l'ensemble d'identification de l'AME à un problème de moment, nous montrons d'abord comment caractériser les bornes d'identification de l'AME de manière directe, sans aucune optimisation. Ensuite, nous considérons deux stratégies pour construire des intervalles de confiance sur l'AME. Dans la première, nous estimons les bornes d'identification à l'aide d'un estimateur semi-paramétrique en deux étapes. La seconde stratégie, très simple, estime plutôt une quantité connue pour être à une distance bornée de l'AME. Elle ne nécessite pas d'estimation non paramétrique mais peut donner lieu en théorie à des intervalles de confiance plus grands. Les simulations de Monte Carlo suggèrent que les deux approches fonctionnent bien en pratique, la seconde étant souvent très compétitive. Enfin, nous montrons que nos résultats s'appliquent également aux effets de traitement moyens, aux fonctions structurelles moyennes et ainsi qu'aux modèles logit ordonnés à effets fixes.

La version complète du manuscrit en langue anglaise est disponible sur Arxiv .

Bibliographie (sélective)

- [1] Armstrong, T. B. and Kolesár, M. (2018), 'Optimal inference in a class of regression models', *Econometrica* 86(2), 655-683.
- [2] Chernozhukov, V., Fernández-Val, I., Hahn, J. and Newey, W. (2013), 'Average and quantile effects in nonseparable panel models', *Econometrica* 81(2), 535-580.
- [3] Dette, H. and Studden, W. J. (1997), *The theory of canonical moments with applications in statistics, probability, and analysis*, Vol. 338, John Wiley & Sons.