

Initiation à l'économétrie des variables qualitatives

François LEGENDRE

Centre d'Études de l'Emploi

Mise en œuvre avec le système Sas

Listing 1 – Les variables sont artificiellement engendrées

```
1 DATA table ;  
2     DO i = 1 TO 100 ; DROP i ;  
3         x = RANNOR(1234567) ;  
4         z = RANNOR(1234567) ;  
5         v = RANUNI(1234567) ; DROP v ;  
6         ye = 2*x - 3*z + LOG(v/(1-v)) ;  
7         y = ye > 0 ;  
8         ybis = NOT y ;  
9         OUTPUT ;  
10    END ;  
11 RUN ;
```

Listing 2 – Quelques statistiques descriptives

```
12 PROC univariate DATA = table ;  
13     VAR x z ye y ;  
14 RUN ;
```

Listing 3 – Une première estimation d'un modèle logit

```
15 PROC probit DATA = table ;  
16     CLASS y ;  
17     MODEL y = x z / DISTRIBUTION = LOGISTIC ;  
18 RUN ;
```

Listing 4 – Une seconde estimation, « à l'endroit »

```
19 PROC probit DATA = table ;  
20     CLASS ybis ;  
21     MODEL ybis = x z / DISTRIBUTION = LOGISTIC ITPRINT ;  
22 RUN ;
```

Listing 5 – L'utilisation des MCO

```
23 PROC reg DATA = table ;  
24     MODEL ybis = x z ;  
25 RUN ;
```