Méthodes économétriques

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 21,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > En savoir plus : Site web de la formation <http://master.eipmc.free.fr/>

Présentation

Préambule : si, pour tenir compte de la situation sanitaire, des restrictions ou des contraintes sont imposées à l'Université Paris Nanterre ou à l'UFR SEGMI, tout ou partie des épreuves, contrôles de connaissances et examens terminaux de la session 1 et de la session 2, ainsi que des sessions de rattrapages, pourront se dérouler en mode distancié.

Ce cours vise à approfondir la théorie de l'économétrie linéaire en traitant des questions d'endogénéité et en l'étendant aux systèmes d'équations. Seront ensuite présentées la méthode des moments généralisés, qui sera appliquée aux modèles économétriques linéaires et non linéaires, ainsi que les méthodes de l'économétrie des variables qualitatives. Tout au long du cours, des applications seront réalisées sur les logiciels usuels.

Chapitre 1 : Endogénéité et Méthode des Variables Instrumentales (VI)

- Endogénéité et conséquences
- Méthode des Variables Instrumentales (VI)
- Tests de spécification

Chapitre 2 : Systèmes d'équations de régression

- Modèles de régressions apparemment indépendantes

- Modèles à équations simultanées

Chapitre 3 : Méthode des Moments Généralisés (MMG)

- Principe général (conditions d'orthogonalité, estimation, propriétés)

- Applications des MMG aux modèles économétriques linéaires et non linéaires

Chapitre 4 : Modèles à réponses qualitatives

- Modèles dichotomiques : Modèle Logit, Modèle Probit
- Modèles polytomiques : Modèles polytomiques ordonnés, Modèles polytomiques non ordonnés (Logit multinomial, Probit multinomial)

Chapitre 5 : Modèles à variable dépendante limitée

- Modèle Tobit simple
- Modèle Tobit généralisé

Objectifs

L'objectif de ce cours est de permettre aux étudiants d'appréhender et maîtriser les méthodes économétriques sur les données continues et discrètes, et d'utiliser ces méthodes de manière appropriée pour expliquer les phénomènes économiques. Des applications seront ainsi réalisées sur des données macroéconomiques et financières, avec des logiciels usuels tels que Stata, Eviews ou R.

Évaluation

Évaluation écrite.

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document.

Pré-requis nécessaires

Pré-requis : Moindres Carrés Ordinaires, Moindres Carrés Généralisés, Correction Robuste à l'hétéroscédasticité et à l'autocorrélation, Variables Instrumentales, Maximum de Vraisemblance.

Compétences visées

Permettre aux étudiants de traiter les problématiques économiques avec les outils appropriés de l'économétrie des données continues et discrètes.

Examens

Evaluation écrite.

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document.

Bibliographie

Bourbonnais, R. (2005), *Econométrie*, Dunod, 6ème édition.

Greene, W. (2011), *Econométrie*, Pearson Education (traduction française), 7ème édition.

Mignon, V. (2008), *Econométrie : Théorie et applications*, Economica.

Thomas, A. (2000), *Econométrie des variables qualitatives*, Dunod.

Wooldridge, J. M. (2010), *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, 2ème édition.

Ressources pédagogiques

Classe interactive

Contact(s)

> **Antonia Lopez villavicencio**

Responsable pédagogique
alopezvi@parisnanterre.fr