

# Master Économie

## Econométrie I - Modèles linéaires

Responsables	Descriptions	Informations
Xavier JOUTARD xavier.joutard@univ-amu.fr	Code : BECAV3A	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion
Habiba DJEBBARI habiba.djebbari@univ-amu.fr	Nature : Domaines : Droit, Économie, Gestion	Nombre de crédits :

### LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

### CONTENU

Fournir aux étudiants les bases de l'économétrie des données de panel (modèles à effets fixes et à erreurs composées). Identifier et traiter les problèmes d'endogénéité dans les modèles économétriques (méthode des variables instrumentales, GMM, Tests).

#### Plan du cours détaillé :

1. Introduction aux données de panel et aux modèles de panel
2. Le modèle à effets fixes
  - Spécification
  - Estimateurs Within et LSDV
  - Test de l'absence d'hétérogénéité non observée.
3. Le modèle à erreurs composées
  - Spécification
  - Estimateurs GLS et FGLS
  - Test de l'absence d'hétérogénéité non observée
  - Test d'Hausman : corrélation entre effets spécifiques et variables explicatives
4. Problèmes d'endogénéité
  - Causes de l'endogénéité dans les modèles économétriques : erreurs de mesures, modèles dynamiques, hétérogénéité non observée, etc.
  - Estimateur des variables instrumentales
  - Estimateur GMM
  - Choix des instruments (cas de séries temporelles, cas des données en coupes et des données de panel)
  - Test de la validité des instruments
  - Test d'exogénéité des régresseurs

### COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Choisir la méthode d'estimation adaptée pour un modèle
- Trouver la bonne spécification d'un modèle à partir des tests

### MODALITÉS D'ORGANISATION

12 sessions of 2 hours each including small exercises.

### BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Économétrie des données de panel : théorie et applications, Alain Pirotte, Economica, 2011.
- Économétrie des données de panel, Patrick Sevestre, Dunod, 2002.

### PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

Économétrie des modèles linéaires : OLS, GLS, FGLS, tests d'autocorrélation et d'hétéroscédasticité.

### VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures
- Cours magistraux: 24 heures

### CODES APOGÉE

- BECA03A [ELP]

### M3C

Aucune donnée M3C trouvée

### POUR PLUS D'INFORMATIONS

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)



Dernière modification le 30/06/2023