

Master Économie

Econométrie II - Modèles non linéaires : variables qualitatives et données de comptage

Responsables	Descriptions	Informations
Xavier JOUTARD xavier.joutard@univ-amu.fr	Code : BECAV3B	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion
Mathieu LEFEBVRE mathieu-julien.LEFEBVRE@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 modèles non linéaires pour des variables dépendantes de nature qualitative - qu'elles soient binaires, multinomiales, ou ordonnées -, pour des variables de comptage ou encore pour des variables dépendantes faisant l'objet de censure ou de troncature.

Détail du cours :

1. Introduction aux modèles non linéaires et rappel du Maximum de Vraisemblance.
2. Modèles pour les variables dépendantes binaires.
 - Le modèle de Probabilité Linéaire.
 - Le modèle Logit.
 - Le modèle Probit.
3. Modèles pour les variables dépendantes multinomiales et ordonnées.
4. Modèles pour les données de comptage.
5. Modèles pour les variables censurées et tronquées.

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Capacité à déterminer la bonne spécification d'un modèle lorsque les variables à expliquer ne sont pas continues.
- Capacité à choisir la méthode d'estimation adéquate pour un modèle donné.
- Capacité à bien interpréter les résultats issus de ces modèles et à en comprendre les limites.

MODALITÉS D'ORGANISATION

12 sessions de 2 heures chacune, chacune incluant des petits exercices.

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Microeconometrics, A.C. Cameron and P.K. Trivedi, Cambridge University Press, 2005.
- Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, J. Wooldridge, the MIT Press, 2002.
- R. Carter-Hill, W.E. Griffiths, G.C. Lim, Principles of Econometrics, Wiley, 2011.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

Bases de l'économétrie linéaire : OLS, GLS, FGLS et les tests associés pour l'autocorrélation et l'hétéroscédasticité.

VOLUME HORAIRE

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

CODES APOGÉE

- BECA03B [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