Master Économie
Econométrie I - Modèles linéaires

Responsables

Xavier JOUTARD
xavier.joutard@univ-amu.fr

Habiba DJEBBARI
habiba.djebbari@univ-amu.fr

Descriptions

Code : BECAV3A

Nature : Élément constitutif

Domaines : Droit, Économie, Gestion

Informations

Composante : Faculté d'Économie et de Gestion

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