

Master Économie

Économétrie approfondie

Responsable	Descriptions	Informations
Emmanuel FLACHAIRE emmanuel.flachaire@univ-amu.fr	Code : BECCV1C Nature : Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion Nombre de crédits :

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

CONTENU

L'objectif est de présenter les méthodes avancées en économétrie pour l'analyse des distributions, des modèles de régression et de classification. Les fondements théoriques des différentes méthodes sont présentés, ainsi que les intuitions sous-jacentes. Elles sont illustrées empiriquement.

Plan du cours détaillé :

- Méthodes de rééchantillonnage
 - Générateur de nombres pseudo-aléatoires
 - Expériences de Monte Carlo
 - Tests bootstrap et tests de permutation
- Econométrie Non-paramétrique
 - Estimation de la densité
 - Modèles de régression et splines
 - Modèles de mélange
- Econométrie et Machine Learning
 - Philosophie et principe général
 - Méthodes basées sur le rééchantillonnage et algorithmes
 - Détection de la mauvaise spécification

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Ahamada et Flachaire (2011) Non-Parametric Econometrics, Oxford University Press
- Efron et Hastie (2016) Computer Age Statistical Inference, Cambridge University Press

VOLUME HORAIRE

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

CODES APOGÉE

- BECC01C [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS

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

