

Master Économie

Méthodes de réduction de l'information

Responsable	Descriptions	Informations
Sullivan HUE sullivan.HUE@univ-amu.fr	Code : BECCV32A Nature : Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion Nombre de crédits :

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

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

CONTENU

- L'objectif de ce cours est d'introduire des méthodes quantitatives permettant de réduire l'information. Ces méthodes couvrent différents champs des statistiques et s'appuie sur des méthodes économétriques classiques (OLS, MLE) ou des méthodes classificatoires ou part composantes principales. L'objectif ultime est d'étudier des méthodes permettant de faire de la sélection automatique de variables dans des problèmes à grande dimension et de les appliquer sur données réelles.

Plan du cours détaillé : Les méthodes de classification

- Les modèles à facteur économiques
- Les modèles à facteurs statistiques
- Les méthodes Lasso
- La méthode dite « Général au spécifique » (Methodologie à la Hendry, Gets ou Autometrics)

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Compréhension de nouvelles méthodes
- Application sur données réelles
- Apprentissage de nouveaux outils ou logiciels économétriques dédiés à la réduction d'information

MODALITÉS D'ORGANISATION

Cours magistral. Evaluation sur base d'un projet de groupe. Rédaction d'un document final et présentation orale.

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Doornik, J.A. and Hendry, D.F. (2015). Statistical model selection with "Big Data", Cogent Economics & Finance, vol 3, n°1, 1-15.
- Hendry, D.F. and Doornik, J.A. (2014). Empirical Model Discovery and Theory Evaluation. Automatic Selection Methods in Econometrics. The MIT Press.
- Richard A. Johnson and Dean W. Wichern, Applied Multivariate Statistical Analysis, Pearson.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

- Statistiques avancées
- Introduction à l'économétrie

VOLUME HORAIRE

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

CODES APOGÉE

- BECC32A [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS



Dernière modification le 30/06/2023