

Master Économie

Modèles pour variables tronquées et censurées

Responsable	Descriptions	Informations
Christophe MULLER Christophe.MULLER@univ-amu.fr	Code : BECDV17B Nature : Élément constitutif Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

CONTENU

L'objectif principal de ce cours est de fournir aux étudiants un cadre de synthèse afin qu'ils puissent comprendre en profondeur et appliquer efficacement à des cas concrets les principales techniques d'estimation ou de tests de modèles à variables dépendantes limitées avec censures ou troncatures.

Plan du cours détaillé :

1. Brefs rappels de fondement de la spécification et de l'estimation de modèles économétriques (GMM, Maximum de vraisemblance, Simulations)
2. Présentation des données censurées et tronquées, variables dépendantes limitées et leur distributions
3. Biais de sélection, perte d'efficacité, identification ponctuelle et partielle
4. Modèles à variable dépendante censurée ou tronquée
5. Modèle de Roy et extensions
6. Modèles à hétérogénéité inobservée en données de panel, et modèles à erreur composées

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

Les compétences visées seront d'abord une compréhension des raisonnements nécessaires à l'utilisation des techniques économétriques enseignées, et à leur mise en œuvre pratique.

MODALITÉS D'ORGANISATION

- Cours magistral
- Examen écrit final
- Quelques séances d'application sur ordinateur

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Amemiya, T., Advanced Econometrics, Basil Blackwell, 1989
- Colin Cameron and Pravin K. Trivedi Microeconometrics Using Stata, Revised Edition, Stata Press, 2010.
- Davidson, R. and McKinnon, J.G., Estimation and Inference in Econometrics, 1993
- Davidson, R. and McKinnon, J.G., Econometric Theory and Methods, 2004
- Gouriéroux, C., Économétrie des Variables Qualitatives, Economica, Paris.
- Greene, W.H., Econometric Analysis, Prentice Hall, 2007
- Koenker, R., Quantile regression, Cambridge University Press, 2005
- Lollivier, S., Économétrie avancée des variables qualitative, Economica, Paris, 2016.
- Long, J.S. and J. Freese, Regression Models for Categorical Dependent Variables Using Stata, Stata Press, 2006
- Maddala, G.S., Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics, Cambridge University Press, 1988
- Stata Manual

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

Econométrie du modèle linéaire, mathématique de l'optimisation, algèbre linéaire, Logiciel Stata, Maximum de vraisemblance, Modèles économétriques de choix discret, Méthode des moments généralisée.

VOLUME HORAIRE

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

CODES APOGÉE

- BECD17B [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