

Master Économie

Econométrie théorique

Responsable	Descriptions	Informations
Russel DAVIDSON russell.davidson@univ-amu.fr	Code : BECDV2B Nature : Élément constitutif Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

CONTENU

Acquérir des compétences en économétrie moderne, à la fois en théorie et en pratique. Les étudiants doivent maîtriser l'utilisation d'un logiciel économétrique.

Plan du cours détaillé :

On reverra rapidement le modèle de régression linéaire, d'un point de vue géométrique.

Ensuite, on étudiera l'estimation au moyen de variables instrumentales, la méthode des moments, et les moindres carrés généralisés.

La matière suivante sera la méthode du maximum de vraisemblance, et les tests d'hypothèse classiques qui s'appuient sur le maximum de vraisemblance.

On étudiera ensuite les modèles à choix discret, tels les modèles probit et logit, et la manière dont ils s'estiment par le maximum de vraisemblance.

Tout au long du cours, on mettra l'accent sur l'utilisation du bootstrap pour la mise en œuvre de l'inférence statistique en économétrie.

MODALITÉS D'ORGANISATION

Il y aura un examen final, et un devoir qui sera effectué sur ordinateur. La note du cours sera normalement la moyenne non pondérée des notes pour ces deux facettes du cours.

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

La principale référence est le manuel : « Econometric Theory and Methods », de Russell Davidson et James MacKinnon, Oxford University Press, 2004.

D'autres références seront proposées de temps en temps, mais seul le manuel est nécessaire.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

L'algèbre matricielle (algèbre linéaire), et une connaissance, pas forcément profonde, d'un logiciel économétrique, par exemple Matlab, Stata, R, etc.

PRÉREQUIS RECOMMANDÉS

Les rudiments du calcul différentiel et intégral.

VOLUME HORAIRE

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

CODES APOGÉE

- BECD04B [ELP]

POUR PLUS D'INFORMATIONS

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



Dernière modification le 10/10/2022