

Econométrie 2
(panel ; variables qualitatives)

(17h30)

M1 -Master MIMSE
Spécialité IREF

Marc-Alexandre Sénégas

Coordonnées

•  Bureau : E326b (bâtiment central, Université de Bordeaux – Site Pessac, 3^{ème} étage)

•  : marc-alexandre.senegas@u-bordeaux.fr

Site : senegas.u-bordeaux4.fr

ECONOMETRIE 2

Chapitre 1

Initiation à l'économétrie de panel

1- Introduction

2- Spécifications des modèles (statiques) en panel

3- Modèles et méthodes d'estimation

3.1- Modèle de pooling (ou à erreurs simples)

3.2- Modèle à effets (individuels) fixes

3.3- Modèle à effets (individuels) aléatoires

3.4- Comparaison des estimateurs

4- Tests de spécification

Chapitre 2

Initiation à l'économétrie des variables qualitatives (modèles à variables dichotomiques)

1- Introduction et typologie des modèles à variables dichotomiques

2- Spécifications des modèles à variables dichotomiques

3- Estimation

3.1- Fonction de vraisemblance et EMV

3.2- Autres estimations

4- Tests dans et sur les modèles à variables dichotomiques

5- Problèmes divers

Quelques références bibliographiques

1- Ouvrages - manuels

- Greene W. (2005), *Econométrie*, Pearson Education France.

[Greene WH (2011). *Econometric Analysis*, 7th ed. Upper Saddle River, NJ: Prentice Hall, chp.13. (voir site web)]

- Dormont B. (2002), *Introduction à l'économétrie des données de panel : théorie et applications à des échantillons d'entreprises*, Editions du CNRS, Paris.

- Hsiao, C. (2003), *Analysis of Panel Data*, second edition, Cambridge University Press.

Thomas A (2000), *Econométrie des variables qualitatives*, Dunod

- Wooldridge JM (2010). *Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data*, 2nd ed. Cambridge, MA: MIT Press.

2- Sur le web :

Thomas Alban, *L'économétrie des panels*

Hurlin Christophe. *L'économétrie des Données de Panel*

...

3- Logiciels :

Eviews

R → Croissant Y & Millo G. *Panel Data Econometrics in R: The plm Package*

STATA