Econométrie des données de panel

Infos pratiques

- **ECTS** : 4.5
- **Nombre d'heures** : 40.0
- **Langue(s) d'enseignement** : Français, Anglais
- **Niveau d'étude** : BAC +4
- **Période de l'année** : Enseignement huitième semestre
- **Méthodes d'enseignement** : En présence
- **Forme d'enseignement** : Cours magistral et Travaux dirigés
- **Ouvert aux étudiants en échange** : Oui
- **Campus** : Campus de Nanterre
- **Composante** : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- **En savoir plus** : https://sites.google.com/view/m1ea/accueil

Présentation

Préambule : si, pour tenir compte de la situation sanitaire, des restrictions ou des contraintes sont imposées à l'Université Paris Nanterre ou à l'UFR SEGMI, tout ou partie des épreuves, contrôles de connaissances et examens terminaux de la session 1 et de la session 2, ainsi que des sessions de rattrapages, pourront se dérouler en mode distancié.

Ce cours a pour objectif de poser les bases des modèles de panel linéaire en s'intéressant à la fois à la spécification, à l'estimation et à l'inférence dans le cadre de ces modèles. Dans un premier temps on présente la problématique de l'hétérogénéité dans un modèle de régression linéaire en panel. Ensuite, on étudie les modèles à effets inobservés : effets fixes versus effets aléatoires ainsi que la classe plus générale des modèles à coefficients aléatoires. Plusieurs exemples économiques illustrent la pertinence des modèles et des méthodes d'estimation décrits.

Plan de cours :

Chapitre 1 : Introduction

Chapitre 2 : Modèles linéaires à effets fixes

Chapitre 3 : Modèle linéaires à effets aléatoires

Chapitre 4 : Test d'Hausman

Objectifs

Ce cours a pour objectif de poser les bases des modèles de panel linéaire. On s'intéresse notamment au biais d'hétérogénéité et aux modèles adaptés à ce problème : le modèle à effets inobservés : méthode des effets fixes versus méthode des effets aléatoires ainsi que la classe plus générale des modèles à coefficients aléatoires. Plusieurs exemples économiques illustrent la pertinence des modèles et des méthodes d'estimation décrits.

Évaluation

Evaluation écrite (partiel traditionnel) et Contrôle continu

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document.

Pré-requis nécessaires

Le cours exige un niveau L3 en probabilités, statistiques, économétrie

Compétences visées

Maîtriser les fondamentaux en modélisation des données macroéconomiques et financières en panel, estimation par MCO et GLS

Examens

Evaluation écrite (partiel traditionnel) et Contrôle continu

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document.

Bibliographie

C. Hsiao, Analysis of Panel Data, Cambridge University Press, 2003.
J. M. Wooldridge, Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, The MIP Press, 2010.
A. Pirotte, Econométrie des données de panel : théorie et applications, Economica
P. Sevestre, Econométrie des données de panel, Dunod

Ressources pédagogiques

Classe interactive

Contact(s)

> Thomas Chuffart
Responsable pédagogique
tchuffart@parisnanterre.fr

> Antonia Lopez villavicencio
Responsable pédagogique
alopezvi@parisnanterre.fr