Économétrie des données de panel avancée

Infos pratiques

- **ECTS** : 3.0
- **Nombre d'heures** : 21.0
- **Langue(s) d'enseignement** : Français
- **Niveau d'étude** : BAC +5
- **Période de l'année** : Enseignement neuvième semestre
- **Méthodes d'enseignement** : En présence
- **Forme d'enseignement** : Cours magistral
- **Ouvert aux étudiants en échange** : Oui
- **Campus** : Campus de Nanterre
- **Composante** : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- **Code ELP** : 5E9ECEDP
- **En savoir plus** : Site du master EIPMC http://master.eipmc.free.fr/

Présentation

Ce cours est orienté sur les outils économétriques avancés de panel spécifiques aux données macroéconomiques et financières. Une première partie du cours porte sur les questions d'autocorrélation et d'hétéroscédasticité, ainsi que sur la présentation du modèle de panel dynamique. La deuxième partie du cours est consacrée à l'économétrie des données de panel non stationnaires. Sont ainsi étudiés de façon approfondie les tests de racine unitaire de première et deuxième générations en panel, ainsi que les tests de cointégration en panel. Les différents tests et méthodes sont présentés de façon théorique et sont systématiquement illustrés par des applications empiriques à des séries économiques ou financières.

Objectifs

Ce cours a pour objectif de poser les bases des modèles de panel linéaires dynamiques et de présenter de façon approfondie les développements les plus récents de l'économétrie des données de panel non stationnaires.

Évaluation

SESSION 1 :
Contrôle Terminal
• Type : Écrit
• Durée : 2h00
Régime Dérogatoire
• Type : Écrit
• Durée : 2h00
SESSION 2 :
• Type : Écrit
• Durée : 2h00
Utilisation de l'intelligence artificielle :
Le recours à l'IA est strictement interdit en vertu de la charte des examens qui prévoit que "pour les épreuves en présentiel : l'usage de téléphones portables, d'objets connectés, de casques audio, d'écouteurs ou de tout autre moyen de communication, même à l'usage d'horloge, permettant notamment la consultation de documents non autorisés et/ou la communication avec une tierce personne, est strictement interdit".

Pré-requis nécessaires

Le cours exige un niveau M1 en probabilités, statistiques, économétrie des séries temporelles, économétrie des données de panel.

Compétences visées

Maîtriser les techniques avancées de modélisation des données macroéconomiques et financières en panel et les techniques d'estimation par variables instrumentales et GMM. A l'issue du cours, l'étudiant doit être à même d'étudier des panels non stationnaires en recourant aux techniques appropriées, notamment selon la présence ou non de dépendance interindividuelle.

Bibliographie

- C. Hsiao (2003), Analysis of Panel Data, Cambridge University Press.
- Hurlin, C. et Mignon, V. (2005), "Une synthèse des tests de racine unitaire sur données de panel", Economie et Prévision, 169-170, 253-294.
- Hurlin, C. et Mignon, V. (2007), "Une synthèse des tests de cointégration sur données de panel", Economie et Prévision, 180-181, pp. 241-265.
- J. M. Wooldridge (2010), Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, The MIP Press.
- A. Pirotte, Econométrie des données de panel : théorie et applications, Economica.
- P. Sevestre, Econométrie des données de panel, Dunod.

Contact(s)

> Valerie Mignon

Responsable pédagogique
mignon@parisnanterre.fr

> Francisco Serranito

Responsable pédagogique
fserrani@parisnanterre.fr