

Econométrie des données de panel avancée

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 21,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français, Anglais
- > 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
- > En savoir plus : Site web de la formation : <http://master.eipmc.free.fr/>

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 est orienté sur les outils économétriques avancés de panel spécifiques aux données macroéconomiques et financières. Une première partie du cours a trait aux questions d'autocorrélation et d'hétéroscédasticité, ainsi qu'à la présentation du modèle de panel dynamique. La deuxième partie du cours est dédiée à l'économétrie des données de panel non stationnaires. Sont ainsi étudiés de façon approfondie les tests de racine unitaire de première et deuxième génération 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.

Plan du cours :

1. Autocorrélation et Hétéroscédasticité dans le panel linéaire
2. Le modèle de panel dynamique
3. Tests de racine unitaire en panel
 - Tests de première génération
 - Tests de deuxième génération
4. Cointégration en panel
 - Notions de cointégration en panel
 - Tests de l'hypothèse nulle d'absence de cointégration
 - Tests de l'hypothèse nulle de cointégration
 - Simulations, estimation et inférence

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

Évaluation écrite.

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

Pré-requis : 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. À 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.

Examens

Evaluation écrite.

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 (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.

Ressources pédagogiques

Classe interactive.

Contact(s)

> **Valerie Mignon**

Responsable pédagogique
mignon@parisnanterre.fr