

Econometrics II

Niveau : Master – première année - M1

Cursus :

Semestre : S1

Volume horaire : 18 heures de cours (CM)

Intervenant : Siwar Khelifa

Contact : khelifa@gate.cnrs.fr

Objectifs du cours :

L'objectif de ce cours est d'introduire la méthode d'estimation de maximum de vraisemblance utilisée quand les données à traiter sont de nature binaire ou catégorielle (variables dépendantes discrètes), et de présenter deux types de modèles à utiliser dans la modélisation de ce type d'estimation : quand la variable dépendante est binaire et quand la variable dépendante est une variable de comptage.

Plan de cours :

3 chapitres à traiter avec une application empirique sur R :

- Chapitre 1: Maximum likelihood estimation
- Chapitre 2: Binary response models
- Chapitre 3: Count models

Compétences développées :

- Etre capable de déterminer la nature du modèle d'estimation à utiliser selon la nature de la variable dépendante.
- Etre capable d'interpréter les résultats de modèle estimés avec la méthode de maximum de vraisemblance.
- Utiliser R pour des estimations simples de modèle à variable dépendante binaire.

Modalités d'évaluation :

Une seule épreuve écrite

Prérequis :

- Modèle de régression linéaire
- Logiciel R (les bases)

Bibliographie / références :

- Wooldridge, J. M. (2010). *Econometric analysis of cross section and panel data*. MIT press.