

SYLLABUS

Intitulé du cours	Econométrie avancée
Numéro de l'UE	
Volume horaire (en heures maquettes)	15 heures
Année d'étude et Semestre	Master 2 EBFI – semestre 1
Objectifs et compétences développées	Proposer aux étudiants une approche approfondie des techniques économétriques afin d'aborder les problèmes complexes de l'analyse économique
Contenu pédagogique	<p>Chapitre 1 – L'économétrie des séries temporelles</p> <p>A – Rappels sur les processus AR, MA, ARMA et les modèles linéaires</p> <p>B – Développement des modèles ARCH / GARCH et introduction aux non linéarités</p> <p>C – Modèles non linéaires et modèles à seuil</p> <ul style="list-style-type: none"> - Modèle à saturation '(Gompertz, Cycle de vie) - Approche par les algorithmes - Modèle à seuil de type Hansen <p>Chapitre 2 – Modèle de variables instrumentales</p> <p>A - Endogénéité/ Erreur de mesure et variables omises</p> <p>B - Choix des instruments</p> <p>C - Approche pas les 2SLS</p> <p>C – Estimateur de Wald</p> <p>Chapitre 3– L'économétrie des données de panel</p> <p>A – Rappel sur les modèles FE / RE</p> <p>B – Traitement des problèmes d'endogénéité</p> <ul style="list-style-type: none"> - Hausman / Taylor - GMM / GMM Système
	De bonnes connaissances en économétrie. Voir cours de master 1. Logiciel STATA
Modalités d'évaluation	Contrôle continu
Références bibliographiques	Principles of Econometrics (2010). R Carter Hill, William E Griffiths and Guay C Lim. Wiley. 4ème édition
Mots Clefs	Série temporelle, Panel, Seuil, endogénéité