

SYLLABUS

Intitulé du cours	Econométrie des données de panel
Numéro de l'UE	UE 2.5
Volume horaire (en heures maquettes)	15 heures de cours
Année d'étude et Semestre	Master 1
Objectifs et compétences développées	<p>Ce cours s'adresse à tous ceux qui désirent acquérir des compétences dans le traitement de données complexes et notamment de données de panel court avec des méthodes économétriques et statistiques qui permettent de prendre en compte l'hétérogénéité des comportements des individus statistiques observés.</p>
Contenu et moyens pédagogiques	<p>Introduction : Rappel sur les différentes façons d'organiser les données (coupe, temporelle, transversale).</p> <p>Avantages et inconvénients de données de panel.</p> <p>Présentation de la notion d'hétérogénéité (exemples)</p> <ul style="list-style-type: none"> - Tests de spécification / Tests homogénéité <p>Présentation de la notion de panel cylindré / non cylindré</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Les modèles à effets individuels <ol style="list-style-type: none"> 1.1 – Empilement par individus 1.2. Empilements par période 2. Les modèles à effets fixes <ol style="list-style-type: none"> 2.1. Les modèles LSDV 2.2. Les modèles Within 3. Les modèles à effets aléatoires 4. Tests de spécification des effets individuels <ol style="list-style-type: none"> 4.1. Test de Fisher 4.2. Test d'Hausman 5. Estimateur inter-individuel <ol style="list-style-type: none"> 5.1. Estimateur Between 5.2 Test de Mindlak

<p align="center">- Pré-requis</p>	<p>2.Statistiques Probabilités Les modèles de régression linéaire simple et multivariés. La maîtrise des tests d'hypothèses (multicolinéarité, homocédasticité, autocorrélation, ...)</p>
<p>Modalités d'évaluation</p>	<p>Contrôle continu</p>
<p align="center">Références bibliographiques</p>	<p>BALTAGI B. [1995], Econometrics analysis of panel data, New-York, North-Holland Bourbonnais, R. [2011], Econométrie : cours et exercices corrigés. Dunod Wooldridge, J. [2018], Introduction à l'économétrie : une approche moderne. Deboeck Greene, W et al. [2011], Econométrie. Pearson Pirotte, A. [2011], Econométrie des données de panel : théorie et applications. Economica</p>
<p align="center">Mots Clefs</p>	<p>Statistiques, Probabilité, Hétérogénéité, Effets fixes, effets aléatoires, Test d'Hausman</p>