



SYLLABUS



Cours : ECONOMETRIE DES VARIABLES QUALITATIVES

Ects : 3

Niveau d'étude : Master 1^{ère} année

Semestre : 2

CM : 30 heures

TD : aucun

Enseignant : Benoît MULKAY

E-mail : benoit.mulkey@umontpellier.fr

Modalité de contrôle des connaissances : Contrôle continu : aucun
Contrôle terminal : écrit 2h

Présentation et objectifs du cours

Ce cours introduit les méthodes d'estimation d'un modèle non linéaire dans la variable dépendante. Cela peut être un modèle de choix discrets dichotomiques (Logit ou Probit) ou polytomiques (Logit multinomial, Logit conditionnel, Logit emboîté, Logit ou Probit ordonné,...), des modèles de comptage (Poisson, Binomial Negative, Zero-inflated,...) ou encore de modèle sur des observations censurées ou tronquées (Tobit, Modèle de Heckman).

On propose les différents estimateurs de ces modèles et on analyse les propriétés de ces estimateurs. On présente dans le cours de nombreuses simulations numériques, ainsi que des exemples. On s'intéresse plus particulièrement aux interprétations des résultats.

Pré-requis (Facultatif)

Statistique 2 (Probabilités et Distributions statistiques)

Introduction à l'économétrie

Econométrie (M1)

Contenu

1. Les variables qualitatives
2. Les modèles à variables dichotomiques : Logit et Probit
3. Les modèles de choix entre plusieurs alternatives
4. Les modèles de comptage
5. Les modèles sur variables tronquées ou censurées
6. Les modèles d'autosélection

Éléments bibliographiques (Facultatif)

Colin CAMERON et Pravin TRIVEDI [2005] : *Microeconometrics – Methods and Applications*, Cambridge University Press.

William H. GREENE [2011] : *Econometric Analysis* (7th édition), Pearson Education. Traduit en français [2011] : *Econométrie* (7^{ème} édition).

G.S. MADDALA [1983] : *Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics*, Cambridge University Press.

Kenneth E. TRAIN [2005] : *Discrete Choice Methods with Simulation* (2nd édition), Cambridge University Press.

Gilbert SAPORTA [2006] : *Probabilités, Analyse des Données et Statistique* (2^{ème} édition), Paris : Editions TECHNIP.

Alban THOMAS [2000] : *Econométrie des variables qualitatives*, Dunod.