

# Econométrie 2



Crédits ECTS  
Echange  
2.0



Composante  
Faculté  
d'Economie  
de Grenoble  
(FEG), UFR  
Sciences de  
l'Homme et  
de la Société  
(SHS)



Période de  
l'année  
Printemps (janv.  
à avril/mai)

- > **Langue(s) d'enseignement:** Français
- > **Ouvert aux étudiants en échange:** Oui
- > **Crédits ECTS Echange:** 2.0

## Présentation

### Description

On étudie dans une 1<sup>ère</sup> partie (Modèles linéaires pour données en coupe) le problème posé par la présence d'endogénéité et son traitement par la méthode des variables instrumentales (VIs). Comme prolongement de l'étude du problème d'endogénéité traité par VIs nous étudierons les modèles à équations simultanées. On étudie dans une seconde partie (Modèles linéaires pour données de panel) les principales méthodes utilisées dans les modèles linéaires pour données de panel (modèles statiques et modèles dynamiques). En termes méthodologiques, ces deux parties nous permettront d'étudier la méthode des moments généralisés, et d'utiliser des résultats classiques de la statistique asymptotique. Le cours sera illustré par des applications et exercices empiriques avec le langage Python (remarque : le cours n'est pas un cours de Python et vous pouvez utiliser le langage de votre choix).

### Objectifs

Maîtriser la pratique des variables instrumentales et les méthodes classiques pour données de panel linéaires.

---

## Heures d'enseignement

Econométrie 2 - CM	CM	12h
Econométrie 2 - TP	TP	12h

---

## Pré-requis recommandés

Statistique (résultats asymptotiques, inférence), Econométrie 1

**Période :** Semestre 6

---

## Informations complémentaires

le matériel du cours sera sur ce dépôt git

🔗 <https://github.com/MWUrda/Cours-UGA-Econ-Econometrie>

---

## Bibliographie

Angrist, J.D., Pischke, J.S. (2009). *Mostly harmless econometrics : An empiricist's companion*. Princeton University Press.

Hansen, B.E. (2017). Econometrics. 🔗 <https://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/econometrics/>.

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

## Infos pratiques

---

### Contacts

Responsable pédagogique

**Michal Urdanivia**

✉ [Michal.Wong-urdanivia@univ-grenoble-alpes.fr](mailto:Michal.Wong-urdanivia@univ-grenoble-alpes.fr), [michal.urdanivia@univ-grenoble-alpes.fr](mailto:michal.urdanivia@univ-grenoble-alpes.fr)

---

### Lieu(x) ville

➤ Grenoble



---

## Campus

› Grenoble - Domaine universitaire