

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^{ère} 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, michal.urdanivia@univ-grenoble-alpes.fr

Lieu(x) ville

> Grenoble



Campus

› Grenoble - Domaine universitaire