

ECONOMETRIE DES VARIABLES QUALITATIVES

1. INTITULÉ DU COURS : ÉCONOMÉTRIE DES VARIABLES QUALITATIVES

Volume horaire : 25 heures

Objectifs du cours :

Ce cours a pour objectif d'introduire l'étude des modèles économétriques à variables dépendantes qualitatives. Ces modèles sont très largement utilisés en micro-économie appliquée (modèle d'offre de travail, crédit scoring,...) et le nombre d'applications en macroéconomie ne cesse d'augmenter (modèle de déséquilibre). Les élèves utiliseront le logiciel STATA lors de ce cours.

Contenu du cours :

Chapitre 1 : Le modèle dichotomique simple (6h)

1. Ecriture du modèle
2. Logit ou Probit ?
3. Etude de la vraisemblance, hiérarchie des variables
4. Le cas d'observations repesées

Chapitre 2 : Les modèles polytomiques (8H)

1. Modèles non ordonnés : logit multinomial, Probit multionomial, Logit conditionnel, Logit mixte ;
2. Modèles ordonnés : Logit multinomial ordonné et extension ;
3. Modèle Logit séquentiel ;
4. Modèles multiniveaux

Chapitre 3 : Introduction aux modèles de comptage (3H)

1. Modèle de poisson
2. Modèle binomial négatif

Chapitre 4 : Le modèle Tobit et modèle de sélection (6h)

1. Ecriture du modèle
2. Etude de la vraisemblance et estimation en deux étapes
3. Modèle Tobit généralisé
4. Modèle de sélection

Chapitre 5 : Les modèles de durée (2H)

1. Introduction ;
2. L'estimateur de Kaplan-Meier ;
3. Les types de modèle ;
4. Le modèle de Cox ;

Contrôle des connaissances : Au moins 1 contrôle écrit

Bibliographie :

Bourdonnais R. (2004), *Econométrie*, Dunod.

Gouriéroux C. (1989), *Econométrie des Variables Qualitatives*, Economica, 2^{ème} Ed. Greene W (1997), *Econometric Analysis*, Prentice Hall, 3^{ème} édition.

Haudeville (1996), *Econométrie Appliquée*, Estem.

Johnston et Dinardo (1997), *Econometric method*, Mc Graw Hill, 4^{ème} édition. Johnston (1988), *Méthodes économétriques*, Tome 1 et 2, Economica.

Judge et Griffith (1997), *Theory and practice of econometrics*, Wiley and Sons, 4^{ème} édition. Monfort et Gouriéroux (1996), *Statistiques et modèles économétriques*, Tome 1 et 2, Economica.