

# **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<sup>ème</sup> Ed. Greene W (1997), Econometric Analysis, Prentice Hall, 3<sup>ème</sup> édition.

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

Johnston et Dinardo (1997), *Econometric method*, Mc Graw Hill, 4<sup>ème</sup> édition. Johnston (1988), *Méthodes économétriques*, Tome 1 et 2, Economica.

Judge et Griffith (1997), *Theory and practice of econometrics*, Wiley and Sons, 4<sup>ème</sup> édition. Monfort et Gourieroux (1996), *Statistiques et modèles économétriques*, Tome 1 et 2, Economica.