

Econométrie des variables qualitatives

Infos pratiques

- > ECTS : 4.5
- > Nombre d'heures : 34.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +4
- > Période de l'année : Enseignement huitième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique

Présentation

Ce cours d'économétrie appliquée est dédié à la modélisation des choix discrets. Après une présentation approfondie des modèles à variable dépendante dichotomique, nous traiterons du cas polytomique et de ses principales extensions. Une initiation aux modèles de comptage sera proposée en complément si le temps le permet. L'exposé théorique de ces méthodes s'accompagnera de mises en œuvre pratiques sous le logiciel libre R.

PLAN INDICATIF :

Chapitre 1 : Modèles à variable dépendante dichotomique

- A. Modèle à probabilités linéaires, probit, logit
- B. Approfondissements

Chapitre 2 : Modèles à variable dépendante polytomique

- A. Probit et logit ordonnés
- B. Logit multinomial
- C. Extensions : nested logit, mixed logit, latent class models

Chapitre 3 : Modèles de comptage (*si le temps le permet*)

Objectifs

Développer les compétences économétriques des étudiants.

Évaluation

Session 1

- Formule standard : L'évaluation s'organisera autour d'une analyse de cas et d'un projet appliqué réalisé par groupes d'étudiants.

- Formule dérogatoire :

Session 2 : Écrit

Compétences visées

À l'issue du cours, les étudiants disposeront de solides connaissances en économétrie des variables qualitatives leur permettant de parcourir la littérature académique et d'appliquer les méthodes présentées en cours sur données réelles grâce à l'acquisition simultanée de compétences dans l'utilisation du logiciel R.

Bibliographie

- * Cameron, A.C et P. K. Trivedi (2005), *Microeconometrics*, Cambridge University Press.
- * Cameron, A.C et P. K. Trivedi (2013), *Regression Analysis of Count Data*, Cambridge University Press.
- * Greene W.H. (2011), *Econometric Analysis (7th edition)*, Pearson Education.
- * Greene W.H. et D.A. Hensher (2010), *Modeling Ordered Choices: A Primer*, Cambridge University Press.
- * Hensher D.A., J.M. Rose et Greene W.H. (2015), *Applied Choice Analysis*, Cambridge University Press.