

Econométrie des Séries Temporelles et de Données de Panels

Présentation de la matière

CM 24h_ TD 12h

Ce cours s'effectue sur deux années (M1 et M2)

Thématiques et objectifs du cours en M2

L'objectif du cours est de présenter les techniques économétriques de base utilisées lorsque l'analyste (en économie, en gestion) se trouve face à des données de panels c'est-à-dire des données présentant à la fois une dimension longitudinale et une dimensions transversale. Ce cours vise à donner les outils permettant de choisir la modélisation économétrique la plus appropriée.

Prérequis

- Statistiques
- Inférences Statistiques
- Econométrie (Niveau M1)

CHAPELLE Karine

Plan du cours

Chapitre 1:

Les particularités des données de Panels

Chapitre 2:

Le modèle à effets fixes : Modèle Within

Chapitre 3:

Le modèle Between

Chapitre 4:

Le modèle à effets fixes aléatoires

Ressources pédagogiques sur le site **Universitice** du Cours :

- Ressources « Livre » de chaque chapitre ;
- Tests d'apprentissage
- Tests et corrections des examens passés
- Libre Office Impress de chaque chapitre et séance de TD
- Enoncés des séances de TD
- Données pour les séances de TD
- Logiciels utilisés
- Références Bibliographiques
- Informations diverses

ATTENTION:

Il est important que les étudiants effectuent leurs démarches administratives le plus tôt possible. En effet, sans inscription administrative valide, l'accès aux ressources pédagogiques ne sera pas possible. Aucun document ne sera distribué en cours ou en TD!

Modalités de contrôle des connaissances

- Contrôle(s) Continu(s) (50%)
 - ▶ 1h30 maximum
 - ▶ Ecrit(s) , Test (s) ou devoir(s) à rendre sur Universitice selon la possibilité du planning/la période de confinement,
- Contrôle Terminal (50%)
 - ▶ 1h30 maximum
 - ▶ Ecrit ou Test sur Universitice, devoir à rendre selon confinement possibilité planning
- Contrôle 2nde session (100%)
 - ▶ 1h30 maximum
 - ▶ Ecrit ou Test sur Universitice selon confinement possibilité planning