

Intermediate Econometrics CM

Course title - Intitulé du cours	Intermediate Econometrics CM
Level / Semester - Niveau / semestre	M1 / S1
School - Composante	Ecole d'Economie de Toulouse
Teacher - Enseignant responsable	CAZALS CATHY
Other teacher(s) - Autre(s) enseignant(s)	
Lecture Hours - Volume Horaire CM	30
TA Hours - Volume horaire TD	10,5
TP Hours - Volume horaire TP	10,5
Course Language - Langue du cours	Français
TA and/or TP Language - Langue des TD et/ou TP	Français

Teaching staff contacts - Coordonnées de l'équipe pédagogique :

catherine.cazals@tse-fr.eu Office : MF425

Modes d'interactions privilégiés : email, RDV

Course's Objectives - Objectifs du cours :

Ce cours propose un approfondissement des principales méthodes utilisées en économétrie appliquée. Plus précisément, un premier chapitre traite de rappels et compléments concernant l'estimation et les tests dans le modèle de régression linéaire. Un deuxième chapitre examine la question de l'endogénéité dans le modèle de régression linéaire, et présente la méthode d'estimation par variables instrumentales. Enfin un troisième chapitre traite de la méthode d'estimation par maximum de vraisemblance avec des applications notamment à des modèles dans lesquels la variable expliquée est qualitative (modèles Logit ou Probit) ou censurée (modèle Tobit, modèle de comptage,...).

Ce cours a une visée « pratique » et a pour objectif de compléter les compétences acquises précédemment en économétrie en enrichissant « la boîte à outils », afin d'être apte à comprendre et traiter de façon rigoureuse une plus grande variété de questions empiriques.

Prerequisites - Pré requis :

modèle de régression linéaire, méthode MCO, tests statistiques usuels

Grading system - Modalités d'évaluation :

contrôle intermédiaire (30%), examen final (70%)

Bibliography/references - Bibliographie/références :

Wooldridge : « Introductory econometrics : a modern approach »

Stock and Watson: "Introduction to econometrics"