

Introductory Econometrics 2 - Beyond the Gaussian Case

Course title - Intitulé du cours	Introductory Econometrics 2 - Beyond the Gaussian Case
Level / Semester - Niveau / semestre	Année 1 – Période 2
School - Composante	Ecole d'Economie de Toulouse
Teacher - Enseignant responsable	Catherine Cazals-Christine Maurel
Other teacher(s) - Autre(s) enseignant(s)	
Other teacher(s) - Autre(s) enseignant(s)	
Other teacher(s) - Autre(s) enseignant(s)	
Other teacher(s) - Autre(s) enseignant(s)	
Lecture Hours - Volume Horaire CM	15 heures
TA Hours - Volume horaire TD	7,5 h
TP Hours - Volume horaire TP	7,5 h
Course Language - Langue du cours	Français
TA and/or TP Language - Langue des TD et/ou TP	Anglais

Teaching staff contacts – Coordonnées de l'équipe pédagogique :

Enseignant CM pour le parcours Economie et MIAHS :

Catherine CAZALS catherine.cazals@tse-fr.eu

Numéro de Bureau : T. 525

Heures de réception : Pendant la période du cours, après rendez-vous par courriel

Mode d'interaction privilégié : A la sortie de la salle de classe.

Enseignant CM pour le parcours Economie et pour le parcours Economie et Droit

Christine MAUREL christine.maurel@tse-fr.eu

Numéro de bureau : T. 358

Heures de réception : Pendant la période du cours, après rendez-vous par courriel

Mode d'interaction privilégié : A la sortie de la salle de classe

Course Objectives – Objectifs du cours :

Cette seconde partie du cours a pour objectif de présenter d'autres problématiques associées à des méthodes d'estimation en dehors des MCO.

Prerequisites – Pré requis :

Cette seconde partie repose sur les acquis de la première partie du cours « Introductory Econometrics : The Gaussian Case »

Practical information about the sessions – Modalités pratiques de gestion du cours :

Les cours s'appuient sur un ouvrage de référence, Wooldridge, 2003, Introductory Econometrics - A Modern Approach, South Western, 2nd edition. Celui-ci doit être systématiquement utilisé pour travailler les matériaux vus en cours. Des auto-évaluations interactives par QCM peuvent avoir lieu en cours. Les énoncés des TDs et des TP sont mis en ligne sur Moodle bien avant les dates des TDs et TP. Il est de rigueur de préparer les sujets (les lire, les assimiler et essayer de les résoudre) avant toutes les séances.

Grading system – Modalités d'évaluation :

Ce cours est évalué en « Contrôle Continu Intégral » :

La note finale est la note maximale entre deux parties :

- Partie 1 : elle est constituée à 60 % de la note d'examen final et à 40 % d'une évaluation intermédiaire.

L'évaluation intermédiaire pourra se présenter sous la forme d'un projet empirique

- Partie 2 : Elle est constituée de la note d'examen final.

Bibliography/references – Bibliographie/références :

L'ouvrage de reference : Wooldridge, 2003, Introductory Econometrics - A Modern Approach, South Western, 2nd edition.

Anderson, Sweeney et Williams, 2011, Statistics for Business and Economics, South-Western

Bertrand et Maumy-Bertrand, 2011, Statistique pour les scientifiques, Dunod

Session planning – Planification des séances Les sujets présentés dans cette seconde partie du cours sont les suivants :

- Le modèle linéaire avec hétéroscédasticité
- Propriétés en grand échantillon des MCO
- Estimation de la variance des OLS (variance robust, autocorrelation, clustering)
- Inférence asymptotique
- Améliorer les estimations des OLS: Les Moindres Carrés Pondérés
- Erreur de mesure et variables omises
- Analyse causale des phénomènes sociaux : experimentation et modèles (données expérimentales vs observées), Paradoxe de Yule-Simpson
- Introduction à la méthode des Variables Instrumentales

Distance learning – Enseignement à distance :

En cas de nécessité, un enseignement à distance sera assuré en mobilisant:

- Classe en ligne interactive
- Vidéo enregistrée de la présentation du matériel pédagogique
- QCM et exercices en ligne
- TP/TD à distance
- Forum...