

Intitulé du cours: Econométrie des variables qualitatives

Course title – Intitulé du cours	Econométrie des variables qualitatives
Level / Semester – Niveau /semestre	M2 / semestre 1
School – Composante	Ecole d'Economie de Toulouse
Teacher – Enseignant responsable	Liliane Bonnal
Other teacher(s) – Autre(s) enseignant(s)	
Lecture Hours – Volume Horaire CM	18 heures
TA Hours – Volume horaire TD	
TP Hours – Volume horaire TP	
Course Language – Langue du cours	Français
TA and/or TP Language – Langue des TD et/ou TP	

Teaching staff contacts – Coordonnées de l'équipe pédagogique : liliane.bonnal@tse-fr.eu ; liliane.bonnal@univ-poitiers.fr

Course Objectives – Objectifs du cours : Expliquer une variable qualitative (à 2 modalités ou plus) ou une variable quantitative tronquée.

Prerequisites – Pré requis : La régression multiple (avec variables explicatives qualitatives) – le maximum de vraisemblance – Théorie des tests – Connaissance minimale du logiciel SAS

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

- **Partie théorique :** classe inversée (vidéos du cours proposées en ligne) et rappels théoriques des modèles et méthodes d'estimation.
- **Partie empirique :** pédagogie par projet. Applications empiriques en utilisant le logiciel SAS.

Grading system – Modalités d'évaluation : Projet réalisé en deux étapes et quizz portant sur des questions de cours.

Bibliography/references – Bibliographie/références :

- 1) Thomas A. (2000), Économétrie des variables qualitatives, Dunod
- 2) Wooldridge J. M., (2010), Econometrics Analysis of Cross Section and Panel Data, The MIT Press
- 3) Crépon B. et Jacquemet N. (2018), Econométrie : méthodes et applications, De Boeck
- 4) Cameron A. C. et Trivedi P. K. (2010), Microéconométrie, Stata Press.
- 5) Maddala G.S. (1983), Limited-dependent and qualitative variables in econometrics,

Session planning – Planification des séances

Chapitre 0 (introduction) : Rappels sur les variables qualitatives, les indicatrices et l'estimation par maximum de vraisemblance

Chapitre 1 : Le modèle qualitatif simple : logit et probit simple

Estimation, vraisemblance, effets marginaux, odds-ratio

Chapitre 2 : Le modèle qualitatif bivarié

Estimation, problème d'identification, calculs des ATE, ATT, ATNT

Chapitre 3 : Le modèle qualitatif multinomial

Modèle ordonné, modèle non ordonné, modèle séquentiel.

Chapitre 4 : Les modèles tronqués ou censurés : Tobit simple et généralisé

Distance learning – Enseignement à distance :

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

- Classe en ligne interactive (zoom)
- des QCM et des exercices en ligne
- des TD à distance (zoom)
- des forums

- *Interactive virtual classrooms*
- *Recorded lectures (videos)*
- *MCQ tests and other online exercises / assignments*
- *Remote (online) tutorials (classes)*
- *Chatrooms*

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...*