Économétrie des variables qualitatives

ECTS : 6

Enseignant responsable : Sandrine DUFOUR-KIPPELEN (https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/dufour-kippelen-sandrine)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

Description du contenu de l'enseignement :

- Modèles à variables qualitatives : modèles Probit et Logit (dichotomiques, ordonnés, non ordonnés)
- Modèles à variables censurées ou limitées
- Modèles de sélection
- Modèles à variables instrumentales
- TP d'application en Stata

Compétences à acquérir :

Etre capable d'étudier des données d'enquêtes en économie du travail, en économie internationale, en économie de la santé, économie industrielle.

Pré-requis recommandés

Statistiques et probabilités niveau licence (max de vraisemblance, théorie des tests), économétrie (modèle linéaire)

Cours recommandé : « SAS et Stata (1) Introduction»

Mode de contrôle des connaissances :

projet sur données réelles (50%) et examen (50%)

Coefficient : 1.00

Bibliographie, lectures recommandées :

Greene W. (2011), Econométrie, Pearson Education

Document susceptible de mise à jour - 04/11/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16