**SYLLABUS COURS MAGISTRAL**

**ECONOMETRIE APPROFONDIE**

**MASTER RECHERCHE 2 (Sciences économiques et de gestion)**

Année académique / Academic year : 2022-2023

**Christian Lambert NGUENA,**

**Agrégé des Universités**

**Contact:** **lambert.nguena@univ-dschang.org**

**Objectif du cours :** Ce cours vise à fournir une base solide dans la théorie et surtout la pratique de l'économétrie pour les économistes. Des applications économiques ponctuent les grands développements théoriques pour permettre aux apprenants de se familiariser avec la pratique.

 **- Estimation des modèles économétriques ;**

 **- Modèles d'équations simultanées ;**

 **- Modèles avec retards;**

 **- Modèles de séries temporelles stationnaires linéaires;**

 **- Modèles de séries chronologiques non stationnaires linéaires;**

 **- Variables intégrées et tests de racine unitaire;**

 **- Modèles de co-intégration et de correction d'erreur ;**

 **- Econométrie des données de panel; test de racine unitaire et de co-intégration en données de panel ;**

 **- Introduction à la Régression qualitative;**

 **- Régression Logit/Probit;**

 **- Régression logit multinomiale;**

 **- Régression qualitative approfondie régression logit imbriquée;**

 **- Modèles de régression censurée;**

 **- Modèles Tobit, modèles Tobit multivariés et simultanés;**

 **- Modèles discrets – continus.**

**Pré requis :** Econométrie 1 (L3) et 2 (M1); Statistiques; Mathématiques et Théorie économique.

**Méthodes pédagogiques :** Remise préalable du support de cours aux étudiants.

**Lieu de formation** : Université de Dschang.

**Langue de formation :** Français et éventuellement anglais.

**Bibliographie indicative:**

William GREENE (2012): Econometric analysis, Pearson (7th edition);

Eric DOR (2009): Econométrie, Pearson education.