

Économétrie

William Greene

Édition francophone
dirigée par

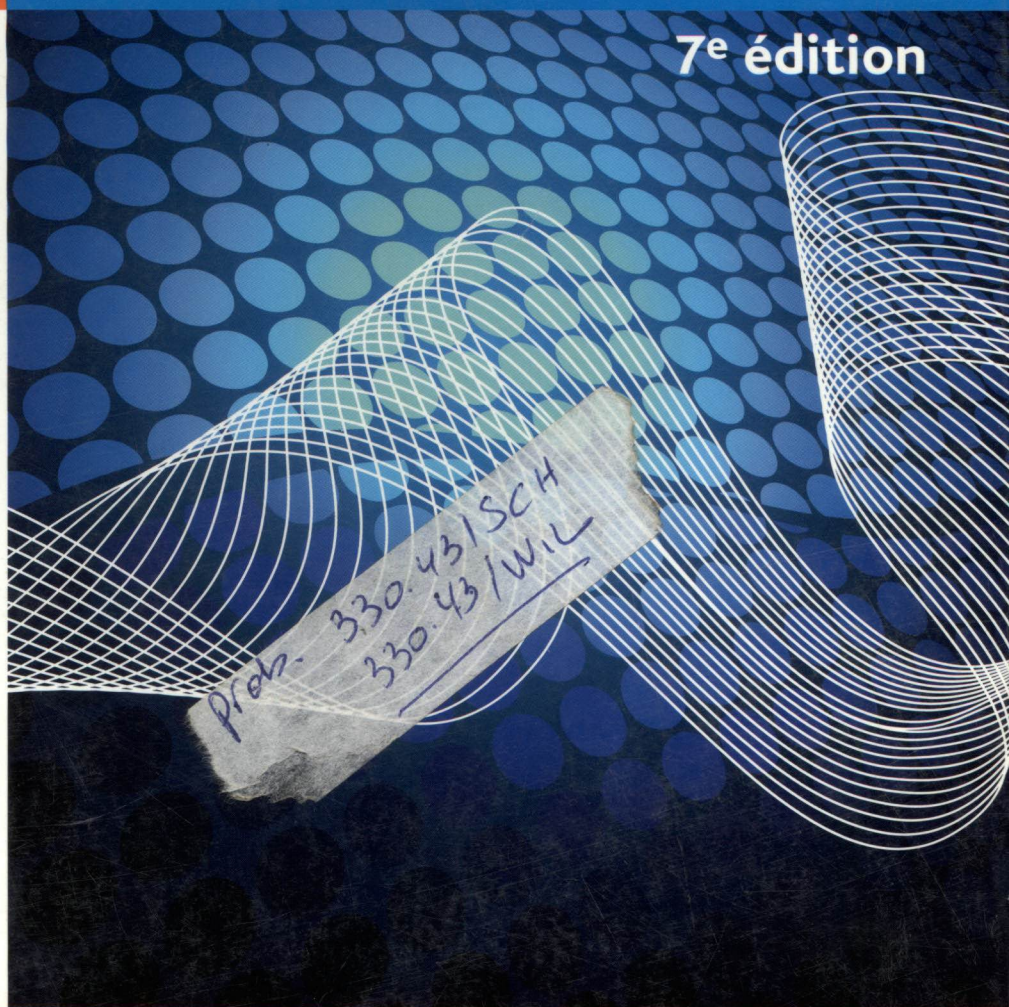
Didier
Schlachter

Théophile Azomahou

Phu Nguyen Van

Wladimir Raymond

7^e édition





Économétrie

7^e édition

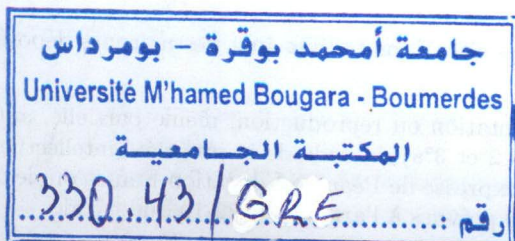
William Greene,
Université de New York

Édition francophone dirigée par **Didier Schlachter**,
IEP Paris, université Paris II

Traduction : **Théophile Azomahou**,
Université des Nations Unies (UNU-MERIT)
Université de Maastricht

Phu Nguyen Van,
BETA-CNRS, université de Strasbourg

Wladimir Raymond,
Institut National de la Statistique
et des **Études Économiques**
du Grand-Duché du Luxembourg (STATEC)



02exp.

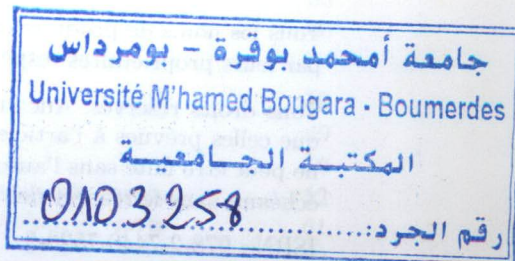


Table des matières

Préface	i
Préface à l'édition française	vii
1 L'économétrie	1
1.1 Introduction	1
1.2 Le paradigme de l'économétrie	1
1.3 Pratique de l'économétrie	4
1.4 Modélisation économétrique	4
1.5 Préliminaires	7
2 Le modèle de régression linéaire	9
2.1 Introduction	9
2.2 Le modèle de régression linéaire	11
2.3 Hypothèses du modèle de régression linéaire	14
3 Les moindres carrés	25
3.1 Introduction	25
3.2 Régression des moindres carrés	25
3.3 Régression partitionnée et régression partielle	32
3.4 Régression partielle et coefficients de corrélation partielle	35
3.5 Qualité d'ajustement et analyse de la variance	38
3.6 Transformée linéaire de régression	45
4 L'estimateur des moindres carrés	49
4.1 Introduction	49
4.2 Les raisons d'adopter les moindres carrés	50
4.3 Propriété à distance finie de l'estimateur des moindres carrés	52
4.4 Propriétés asymptotiques de l'estimateur des moindres carrés	61
4.5 Estimation par intervalle	73
4.6 Prédiction et prévision	77
4.7 Problèmes de données	86

5	Tests d'hypothèse et sélection de modèles	103
5.1	Introduction	103
5.2	Méthodologie de test d'hypothèse	104
5.3	Deux procédures de test d'hypothèse	108
5.4	Test de Wald fondé sur la distance	110
5.5	Test de restrictions fondé sur la régression	116
5.6	Perturbations non normales et tests de grands échantillons	123
5.7	Test de restrictions non linéaires	127
5.8	Choix entre modèles non emboîtés	129
5.9	Test de spécification	131
5.10	Construction de modèle : du général au particulier	133
6	Forme fonctionnelle et changement structurel	139
6.1	Introduction	139
6.2	Variables binaires	139
6.3	Non-linéarité dans les variables	149
6.4	Modélisation et test de changement structurel	158
7	Modèles de régression non linéaire, semi-paramétrique et non paramétrique	169
7.1	Introduction	169
7.2	Modèles de régression non linéaires	170
7.3	Régressions médiane et quantile	191
7.4	La régression partiellement linéaire	199
7.5	La régression non paramétrique	201
8	Endogénéité et estimation par variables instrumentales	207
8.1	Introduction	207
8.2	Hypothèse du modèle étendu	211
8.3	Estimation	213
8.4	Deux tests de spécification	222
8.5	Erreur de mesure	228
8.6	Estimation par variables instrumentales non linéaires	235
8.7	Instruments faibles	238
8.8	Expériences naturelles et la recherche d'effets causals	240
9	Modèle de régression généralisée et hétéroscédasticité	245
9.1	Introduction	245
9.2	Estimation inefficace par les moindres carrés et variables instrumentales	246
9.3	Estimation efficace par les moindres carrés généralisés	252
9.4	Hétéroscédasticité et moindres carrés pondérés	256
9.5	Tests d'hétéroscédasticité	263
9.6	Moindres carrés pondérés	265

10 Systèmes d'équations	277
10.1 Introduction	277
10.2 Le modèle de régressions apparemment indépendantes (SUR)	279
10.3 Régressions apparemment indépendantes généralisées	292
10.4 Systèmes non linéaires d'équations	292
10.5 Système d'équations de demande : systèmes singuliers	294
10.6 Modèles à équations simultanées	302
11 Modèles de données de panel	329
11.1 Introduction	329
11.2 Modèles de données de panel	330
11.3 Modèle de régression groupée	335
11.4 Le modèle à effets fixes	345
11.5 Effets aléatoires	356
11.6 Perturbations non sphériques et estimation robuste de la covariance	370
11.7 Autocorrélation spatiale	375
11.8 Endogénéité	379
11.9 Régression non linéaire avec données de panel	398
11.10 Système d'équations	402
11.11 Paramètres hétérogènes	403
12 Méthodes d'estimation	417
12.1 Introduction	417
12.2 Estimation paramétrique et inférence	418
12.3 Estimation semi-paramétrique	424
12.4 Estimation non paramétrique	428
12.5 Les propriétés des estimateurs	432
13 Estimation de la distance minimale et la méthode des moments généralisée	439
13.1 Introduction	439
13.2 Estimation convergente : la méthode des moments	441
13.3 Estimation de la distance minimale	448
13.4 L'estimateur de la méthode des moments généralisée (MMG)	454
13.5 Tests d'hypothèses dans un cadre théorique MMG	465
13.6 Estimation MMG des modèles économétriques	468

Économétrie

7^e édition

Véritable référence mondiale, cet ouvrage est à la fois un manuel d'initiation aux pratiques économétriques et le livre de chevet des spécialistes de la discipline. Fourmillant d'exemples, il part des concepts fondamentaux avant de développer des aspects de plus en plus techniques :

- le modèle de régression multiple, l'estimateur des moindres carrés linéaires, le modèle de régression non linéaire, l'estimation par variables instrumentales ;
- le modèle de régression généralisée, l'homoscédasticité et l'hétéroscédasticité, les données de panel ;
- les méthodes d'estimations paramétrique, non paramétrique et semi-paramétrique, la méthode des moments généralisée (MMG), l'estimation par maximum de vraisemblance, les méthodes bayésiennes ;
- les modèles de choix discrets, la censure, la troncature, la sélection d'échantillon, la durée, les effets de traitement et l'analyse des données de comptage ;
- les séries temporelles : les modèles avec corrélation sérielle et les modèles de régression pour les données non stationnaires.

Le lecteur est amené à expérimenter l'usage que l'on peut faire des logiciels dédiés : Stata, SAS, LIMDEP, Gauss, etc. Il pourra également vérifier ses connaissances grâce aux exercices de fin de chapitre.

Dans cette nouvelle édition :

- de nouveaux développements sur la prédiction, les modèles des données de panel et les effets d'interaction dans les modèles non linéaires ;
- une approche inédite des méthodes de simulation, en particulier le bootstrapping, les études de Monte Carlo et les intervalles de confiance ;
- des techniques supplémentaires sur l'endogénéité et ses implications ;
- des applications récentes, notamment sur la régression par quantile et la modélisation des choix discrets.

Public : étudiants en universités, écoles de management et écoles d'ingénieurs ; professionnels de la banque, de la finance, de l'assurance

Cours : économétrie

Niveau : master, doctorat

Pearson France

William Greene est professeur d'économie à l'Université de New York.

Didier Schlachter est professeur à l'Institut d'Études Politiques de Paris et chargé de cours à l'Université Paris II. Il a été coordonnateur des enseignements de techniques quantitatives à l'ENA et coordonne aujourd'hui ces disciplines dans les Masters de Sciences Po.

Théophile Azomahou est professeur de recherche à l'Université des Nations Unies (UNU-MERIT) et professeur d'économie à l'Université de Maastricht (School of Business and Economics, SBE).

Phu Nguyen Van est chargé de recherche au CNRS, membre du Bureau d'Economie Théorique et Appliquée (CNRS et Université de Strasbourg).

Wladimir Raymond est chargé de recherche à l'Institut National de la Statistique et des Études Économiques du Grand-Duché du Luxembourg (STATEC).



http://wps.pearson.fr/econometrie_7

Des ressources en accès libre et illimité :

- Des exercices d'application bonus
- Les données utiles aux exercices
- Des rappels des pré-requis en algèbre, analyse et probabilités
- Des références bibliographiques complètes et à jour

Des ressources numériques supplémentaires sont également proposées aux enseignants. Visitez notre site www.pearson.fr pour plus d'informations.

ISBN : 978-2-7440-7528-5

7528 1211 61 €