

## Cours - Introduction à l'économétrie des données de panels

Cadoret I.

1 Présentation du modèle de base

2 Le modèle à effets fixes individuels

2.1 Estimation du modèle

2.2 Test de la présence d'effets individuels fixes

2.3 Généralisation du modèle à effets fixes

2.4 Modèles à effets individuels fixes dynamiques

2.5 Tests sur les modèles à effets individuels fixes dynamiques

3 Le modèle à effets individuels aléatoires

3.1 Estimation du modèle

3.2 Test des effets individuels aléatoires : le test de Breush Pagan

3.3 Modèles à effets individuels aléatoires corrélés avec les régresseurs

3.4 Modèles à effets individuels aléatoires dynamiques

Bibliographie :

P. Sevestre, 2002, Econométrie des données de panel, Dunod