

Concours Magistère de Développement Économique – 3ème année

Vendredi 16 mai 2014

Durée : trois heures

Documents et calculatrices non autorisés.

ÉCONOMIE/ÉCONOMÉTRIE

**Concours d'entrée en magistère de développement économique :
Troisième année**

*Remarques : la durée est de 3 heures, les documents et la calculatrice ne sont pas autorisés.
Les sujets d'économie et d'économétrie devront être composés sur des copies séparées.*

Première partie : Economie

Le candidat répondra à **1 des 2** questions suivantes.

- I) Quelle est la portée de l'économie expérimentale ?
- II) Intégration monétaire et croissance : quelles relations ?

Econométrie

Le candidat définira **20 des 25** concepts suivants

- 1) Estimateur sans biais
- 2) Estimateur convergent
- 3) Estimateur efficace
- 4) Estimateur des moindres carrés généralisés
- 5) Estimateur Logit
- 6) Estimateur GMM
- 7) Test de racine unitaire de Dickey et Fuller
- 8) Test de suridentification
- 9) Test de normalité des résidus

- 10) Relation de co-intégration
- 11) Forme réduite d'un modèle
- 12) Equation d'instrumentation
- 13) Variable instrumentale faible
- 14) Causalité à la Granger
- 15) Estimateur de panel à effets aléatoires
- 16) Biais de sélection
- 17) Conséquences des erreurs de mesure sur la variable expliquée
- 18) Processus MA(q)
- 19) Processus ARMA(p,q)
- 20) Variable fortement stationnaire
- 21) Modèle VAR(p)
- 22) Théorème de Frisch-Waugh
- 23) Modèle à correction d'erreurs
- 24) Filtre de Hodrick-Prescott
- 25) Marche aléatoire