

MASTER 2

MENTION ECONOMIE PARCOURS EXPERTISE ECONOMIQUE

METHODES STATISTIQUES DE L'EVALUATION / S3

ENSEIGNANT :

Nom : Salies
Prénom : Evens
Mail : evens.salies@sciencespo.fr

OBJECTIFS DE L'ENSEIGNEMENT :

L'économiste répond à des questions causales en s'appuyant le plus souvent sur des protocoles quasi-expérimentaux. Il existe malheureusement des biais d'estimation inhérents à ce type de protocoles. Par exemple, un effet de sélection dans l'étude de programmes pilotes d'économie d'énergie auxquels ne participent que les ménages les plus motivés. Ou, un effet d'aubaine dans les études sur l'impact d'aides à la R&D impliquant des entreprises qui n'avaient pas besoin d'être aidées. Ces biais s'apparentent parfois au biais classique de variable omise en économétrie quand, par exemple, on étudie le « rendement de l'éducation » (la relation entre le salaire et le nombre d'années d'études) sans pouvoir contrôler des aptitudes non-observables des diplômé-e-s.

Objectifs du cours. Apprendre les méthodes qui permettent d'atténuer ce type de biais. Familiariser les élèves avec l'approche contrefactuelle de l'inférence causale.

PRE-REQUIS :

Certaines méthodes de l'économétrie des variables quantitatives et qualitatives que vous avez vues en M1 seront utiles à la compréhension de ce cours

PLAN / SOMMAIRE :

1. Introduction. L'EPPP. L'évaluation est dans la loi. Pourquoi évaluer ? Des exemples.
2. Corrélation / causalité, Approches de l'évaluation, Modèle de Neyman-Rubin
3. Protocole expérimental, Mécanisme d'affectation des traitements, Randomisation
4. Estimateurs de Fisher / Neyman, Tests exact de Fisher / test de Wald
5. Biais de sélection, Déséquilibre, Non-recouvrement, Indépendance conditionnelle
6. Stratification, Effet sur les traités / non-traités
7. Appariement exact / score / pondération à la Horowitz-Thompson
8. Exogénéité, Régression continue et régression en discontinuité
9. Variables instrumentales
10. Double et triple différences, Contrôle synthétique

ELEMENTS BIBLIOGRAPHIQUES :

Une courte introduction littéraire, dans une note du conseil d'analyse économique :
Conseil d'Analyse Economique (2013). Évaluation des politiques publiques. Note 1, pp. 1-12.

Un ouvrage en anglais d'introduction aux méthodes économétriques d'évaluation :
Angrist, J.D., Pischke, J.-S. (2009). *Mostly Harmless Econometrics - an Empiricist's Companion*.
Princeton, New Jersey: Princeton University Press.