

Théorie et pratique de l'économétrie

**ECTS** : 4

**Volume horaire** : 24

**Description du contenu de l'enseignement :**

Modèle de régression simple, modèle linéaire, tests par analyse de la variance, violation des hypothèses (auto-corrélation et hétéroscédasticité)

**Compétence à acquérir :**

Ce cours alterne les aspects théoriques de l'estimation statistique, et de l'économétrie, ainsi que la mise en oeuvre opérationnelle de ces modèles à l'aide du logiciel GRETL. L'objectif est qu'à l'issue des 8 séances de ce semestre, les étudiants puissent résoudre par eux-mêmes les problèmes d'estimations classiques auxquels ils pourraient être confrontés.

**Mode de contrôle des connaissances :**

Projet sur GRETL et examen terminal

**Bibliographie, lectures recommandées :**

BOURBONNAIS R., Économétrie, DUNOD. 10<sup>ème</sup> édition. 2020.

BOURBONNAIS R., Exercices pédagogiques d'économétrie avec corrigés et rappel synthétique de cours. Economica. 3<sup>ème</sup> Edt., Janvier 2015.

GREENE W. H., Économétrie, Pearson, 2011.

**Document susceptible de mise à jour - 15/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL** - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16