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., Econométrie, DUNOD. 10 ème édition. 2020.
BOURBONNAIS R., Exercices pédagogiques d'économétrie avec corrigés et rappel synthétique de cours. Economica. 3 ème Edt., Janvier 2015.
GREENE W. H., Econométrie, Pearson, 2011.