

Econométrie

ECTS : 4

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours alterne les aspects théoriques de l'estimation statistique, et de l'économétrie, ainsi que la mise en œuvre opérationnelle de ces modèles à l'aide du logiciel GRETL/R. Les thèmes suivants sont abordés : modèle de régression linéaire simple et multiple, calcul de vraisemblance, tests par analyse de la variance, violation des hypothèses (autocorrélation et hétéroscédasticité), multicollinéarité et sélection des variables.

Compétence à acquérir :

Les bases de l'économétrie classique : estimation par moindres carrés ordinaires, réalisation des tests statistiques usuels, détection et correction de l'autocorrélation et de l'hétéroscédasticité, effectuer des prévisions.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen terminal

Bibliographie, lectures recommandées :

BOURBONNAIS R., Econométrie, DUNOD. 11^{ème} édition. 2021.

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.

Document susceptible de mise à jour - 11/02/2026

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