Introduction à l'économétrie

ECTS : 4

Enseignant responsable : Pascal ACHARD (https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/achard-pascal)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours présente les aspects théoriques de l'économétrie, ainsi que la mise en oeuvre opérationnelle des modèles économétriques et des tests à l'aide du logiciel GRETL.

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

Compétences à acquérir :

L'objectif est qu'à l'issue des 12 séances du semestre, les étudiants puissent résoudre par eux-mêmes les problèmes d'estimations classiques auxquels ils pourraient être confrontés, et interpréter les résultats de l'estimation d'un modèle économétrique.

Pré-requis recommandés

Cours de statistiques : théorie des tests

Mode de contrôle des connaissances :

Projet sur GRETL, examen intermédiaire et 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 - 04/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16