Théorie et pratique de l'économétrie

ECTS : 4

Enseignant responsable : Thomas HOSSEN

Langue du cours : Français

Volume horaire : 30

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).

Compétences 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 étudiantes et les étudiants puissent résoudre par eux-mêmes les problèmes d'estimations classiques auxquels ils pourraient être confrontés.

Pré-requis obligatoires

- Cours de statistiques : Théorie des tests.

Mode de contrôle des connaissances :

- Projet sur GRETL
- Examen terminal.

Coefficient : 2.00

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.

Document susceptible de mise à jour - 03/11/2026

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