Econométrie

ECTS : 4

Enseignant responsable : Sylvain BENOIT (https://sites.google.com/site/sylvainbenoit87/)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

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. Les thèmes suivants sont abordés :

- Modèle de régression simple
- Modèle linéaire
- Tests par analyse de la variance
- Violation des hypothèses (auto-corrélation et hétéroscédasticité)
- Multicolinéarité et sélection des variables.

Compétences à acquérir :

Les bases de l'économétrie classique :

- Moindres carrés ordinaires
- Les tests statistiques usuels
- Les moindres carrés généralisés.

Pré-requis obligatoires

Cours de statistique (théories des tests).

Mode de contrôle des connaissances :

- Examen terminal.

Coefficient : 1.00

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.