Econométrie

ECTS : 4

Enseignants : Renzhi LIU, Pascal ACHARD, Marta MENENDEZ
https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/liu-renzhi
https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/achard-pascal
https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/menendez-marta

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

Description du contenu de l'enseignement :

- 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 :

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. L'objectif est qu'à l'issue des 12 séances du semestre, les étudiantes et 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 obligatoires

Cours de statistiques :

- Théorie des tests.

Mode de contrôle des connaissances :

Projet sur GRETL, examen intermédiaire et examen terminal.

Coefficient : 1.00

Bibliographie, lectures recommandées :

- BOURBONNAIS R., Econométrie, DUNOD. 11e édition. 2021 ;
- BOURBONNAIS R., Exercices pédagogiques d'économétrie avec corrigés et rappel synthétique de cours. Economica. 3e 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