Microéconométrie

ECTS : 3

Enseignant responsable : Philippe DE VREYER (https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/de-vreyer-philippe)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

Description du contenu de l'enseignement :

- Rappel des notions essentielles en probabilités et statistiques - distribution d'échantillonnage et inférence.
- Présentation des modèles de régression simple et multiple.
- Présentation des conditions sous lesquelles les paramètres de ces modèles sont estimés sans biais (théorème de Gauss-Markov), ainsi que les conséquences de la violation de ces conditions.
- Présentation des principales solutions imaginées pour résoudre ces difficultés et les conditions de leur mise en œuvre.
- Introduction à l'économétrie des données de panel
- Introduction aux modèles de variables qualitatives dichotomiques

- Sensibiliser les étudiants aux pièges de l'économétrie linéaire et aux méthodes destinées à les contourner.

Compétences à acquérir :

- Comprendre le principe de la régression. - Savoir sous quelles conditions les estimations obtenues avec cette technique sont sans biais et avec un maximum de précision. - Savoir reconnaître les situations où ces conditions ne sont pas vérifiées. - Savoir ce qu'il faut faire dans ce cas de figure.

Pré-requis recommandés

Cours de théorie des probabilités et de statistique

Mode de contrôle des connaissances :

Contrôle continu et examen

Document susceptible de mise à jour - 04/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16