Econométrie

ECTS : 4

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.

Compétence à acquérir :

Les bases de l'économétrie classique :

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

Mode de contrôle des connaissances :

- 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 - 05/11/2026

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