



SYLLABUS



Niveau d'étude : Licence 3

ECTS : 5

Semestre : 5

Cours : **Introduction à l'économétrie**

CM : 20 heures

Enseignant : Françoise SEYTE

TD : 15 heures

E-mail : francoise.seyte@umontpellier.fr

Modalité de contrôle des connaissances : contrôle continu (TD) + examen terminal écrit d'1h (CM)

Présentation et objectifs du cours

L'objet de ce cours est de s'exercer à la modélisation linéaire à 2 variables

Pré-requis

Cours statistique 4 : statistique inférentielle

Contenu

Un chapitre introductif fait l'historique de l'Econométrie

Le Chapitre 1 est consacré au modèle linéaire simple à 2 variables : formalisation, hypothèses de base, estimateurs des MCO, propriétés des estimateurs, intervalle de confiance et tests de validité du modèle, étude de la corrélation, analyse de la variance et utilisation du modèle pour la prévision

Le Chapitre 2 s'intéresse au modèle linéaire général à 2 variables : tests de normalité, d'homoscédasticité, de non autocorrélation et stabilité du modèle

Éléments bibliographiques

« Econométrie » R. Bourbonnais Dunod

« Econométrie » Johnston Dinardo

« Econométrie » Greene Pearson

« Econométrie » E. Dor Pearson

« L'économétrie : des origines aux développements récents » Pirotte CNRS Editions