



SYLLABUS



Cours : ECONOMETRIE

Ects : 3

Niveau d'étude : Licence 3^{ème} année

Semestre : 2

CM : 20 heures

TD : 15 heures

Enseignant : Benoît MULKAY

E-mail : benoit.mulkey@umontpellier.fr

Modalité de contrôle des connaissances : Contrôle continu : 1 interrogation écrite + 1 QCM
Contrôle terminal : écrit 2h

Présentation et objectifs du cours

Le cours "Econométrie" en 3^{ème} année de Licence d'Economie prolonge le cours "Introduction à l'Econométrie" donné par Mme Seyte au premier semestre. Le cours est optionnel pour les étudiants, mais il est fortement conseillé pour ceux qui veulent poursuivre en Master d'Economie dans la mention Monnaie, Banque, Finance, Assurance.

Il vise à développer la méthode d'estimation par moindres carrés dans un modèle de régression multiple. On se focalisera sur les interprétations des résultats des estimations, et sur les tests d'hypothèses. Le cours sera illustré de nombreux exemples d'application que les étudiants pourront faire par eux-mêmes sur des données qui sont disponibles.

Pré-requis (Facultatif)

Statistique 2 (Probabilités et Distributions statistiques)

Statistique 3 (Inférence statistique)

Introduction à l'économétrie

Contenu

- 1) La nature de l'économétrie et la structure des données économiques
- 2) Le modèle de régression linéaire simple
- 3) Le modèle de régression linéaire multiple
- 4) L'inférence statistique dans le modèle de régression
- 5) Résultats asymptotiques des MCO dans le modèle de régression
- 6) Questions additionnelles sur le modèle de régression
- 7) Le modèle de régression avec information qualitative
- 8) L'hétéroscédasticité
- 9) Compléments sur la spécification et la question des données
- 10) Analyse économétrique simple des séries temporelles
- 11) Utilisation des MCO pour l'analyse des séries temporelles
- 12) Autocorrélation et hétéroscédasticité dans l'analyse des séries temporelles

Éléments bibliographiques (Facultatif)

Jeffrey WOOLDRIDGE : "Introductory Econometrics : A Modern Approach" (5th edition), 2012, South-Western College Publishing

Traduit en français : « Introduction à l'économétrie : Une approche modern", 2015, De Boeck – Ouvertures Economique.