



SYLLABUS



Niveau d'étude : Master 1

ECTS : 6

Semestre : 1

Cours : **Économétrie**

CM : 40 heures

Enseignant : Roman MESTRE

TD : 15 heures

E-mail : roman.mestre@umontpellier.fr

Modalité de contrôle des connaissances : Contrôle continu (TD) + examen terminal écrit de 1.5H(CM)

Présentation et objectifs du cours

Ce cours d'économétrie a pour but de donner les bases de l'estimation des paramètres d'un modèle linéaire multiple. Il considère les estimateurs par moindres carrés à plusieurs variables explicatives. On discute les propriétés en petits échantillons ou asymptotiques de ces estimateurs. On présente également les tests sur les paramètres et les résidus du modèle. On aborde les questions de l'hétéroscédasticité, d'autocorrélation et de normalité des erreurs, ainsi que les estimateurs des moindres carrés généralisés.

Pré-requis

Statistique 2 (Probabilités et Distributions statistiques)
Statistique 3 (Inférence statistique)
Introduction à l'économétrie

Contenu

La régression multiple, Les propriétés de l'estimateur des MCO, Les tests d'hypothèse, Les propriétés asymptotiques des estimateurs, L'hétéroscédasticité, L'autocorrélation des erreurs, la normalité, Les moindres carrés généralisés.

Éléments bibliographiques

Valérie MIGNON, Econométrie – Théorie et Applications- 2eme Editions- Corpus Economie chez Economica
Régis BOURBONNAIS, Econométrie - Manuel et Exercices Corrigés, chez Dunod
Régis BOURBONNAIS, Michel TERRAZA, Analyse des séries temporelles : Application à l'économie et à la gestion, chez Dunod