



SYLLABUS



Cours : ECONOMETRIE

Ects : 3

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

Semestre : 1

CM : 20 heures

Enseignant : Benoît MULKAY

E-mail : benoit.mulkay@umontpellier.fr

Modalité de contrôle des connaissances : Contrôle terminal : écrit 2h

Présentation et objectifs du cours

Le cours "Econométrie" en 3^{ème} année de la Bi-Licence d'Economie-Science Politique prolonge les cours antérieurs de Statistiques. Le cours est optionnel pour les étudiants, mais il est fortement conseillé pour ceux qui veulent poursuivre en Master d'Economie ou dans le domaine de l'analyse quantitative.

On abordera dans le cours l'estimation et le test d'un modèle économique pour quantifier une relation économique, pour évaluer les effets d'une politique ou pour élaborer une prévision. On étudiera 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 1 (Statistiques descriptives)

Statistique 2 (Probabilités et Distributions statistiques)

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) Questions additionnelles sur le modèle de régression
- 6) Le modèle de régression avec information qualitative
- 7) L'hétéroscédasticité
- 8) Compléments sur la spécification et la question des données
- 9) Analyse économétrique simple des séries temporelles
- 10) Autocorrélation et hétéroscédasticité dans l'analyse des séries temporelles

Éléments bibliographiques (Facultatif)

Jeffrey WOOLDRIDGE : "Introductory Econometrics : A Modern Approach" (7th edition), 2019, South-Western College Publishing

Traduit en français : « Introduction à l'économétrie : Une approche moderne (3^{ème} édition)", 2023, De Boeck – Ouvertures Economique.