

Économétrie 2

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 40,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +3
- > Période de l'année : Enseignement sixième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > Code ELP : 4E5OF503

Présentation

Introduction

Chapitre 1 : Hétéroscédasticité et autocorrélation des erreurs

Chapitre 2 : Multicolinéarité

Chapitre 3 : Changements structurels et variables indicatrices

Objectifs

Différentes hypothèses du modèle de régression classique seront remises en cause (homoscédasticité et autocorrélation des erreurs, absence de multicolinéarité, absence de changement structurel).

On traitera quatre questions pour chacun de ces problèmes :

1. Quelle est la nature du problème ?
2. Quelles sont les conséquences théoriques et pratiques ?
3. Comment peut-on le détecter ?

4. Quelles sont les mesures correctives ou les méthodes alternatives qui peuvent être considérées pour remédier au problème ?

Évaluation

• Session 1

Formule standard :

Type : Écrit

Durée : 1h

Contenu : 50% CC + 50% CT (QCM 1 heure)

Formule dérogatoire :

Type : Écrit

Durée : 1h

Contenu : 100% CT (QCM 1 heure)

• Session 2 :

Type : Écrit

Durée : 1h

Contenu : QCM

Pré-requis nécessaires

Cours d'Économétrie 1 (L3, S5)

Compétences visées

Chaque chapitre sera illustré par des exemples d'applications économiques.

A l'issue du cours, les étudiants sauront :

1. lire et interpréter les résultats de l'estimation d'un modèle économétrique ;
2. effectuer des tests économétriques pour détecter la présence d'hétéroscédasticité ou d'autocorrélation des erreurs, de multicolinéarité, de changements structurels et interpréter les résultats de ces tests ; et
3. modifier, le cas échéant, le modèle à estimer ou changer de méthode d'estimation afin d'obtenir le meilleur estimateur linéaire sans biais.

Bibliographie

- Bourbonnais R., Econométrie, Dunod.

- Gujarati D. N., Basic Econometrics, Mac Graw Hill International Editions.
- Mignon V., Econométrie. Théorie et applications, Economica.
- Wooldridge J. M., Introduction à l'économétrie, deboeck.

Contact(s)

> Patricia Maissant renou

Responsable pédagogique
patricia.mr@parisnanterre.fr