

Master Finance

Econométrie

Responsable	Descriptions	Informations
Emmanuel FLACHAIRE emmanuel.flachaire@univ-amu.fr	Code : BFIAV3C Nature : Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion Nombre de crédits :

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Français

CONTENU

Objectifs :

Ce cours est destiné à présenter les fondements de l'économétrie. Les techniques et concepts fondamentaux sont exposés. Ils sont illustrés à partir de nombreux exemples tirés de données réelles afin de montrer comment les économètres procèdent pour analyser un problème économique.

Plan du cours détaillé :

Qu'est ce que l'économétrie ?

- Introduction
- Illustration 1: l'impact de la taille des classes sur la réussite scolaire
- Illustration 2: où sont passés les criminels ?
- Illustration 3: les déterminants des prix des logements

Le modèle de régression simple

- Introduction à l'analyse de régression
- L'estimation par Moindres Carrés Ordinaires (MCO)
- Propriétés statistiques des MCO
- Les intervalles de confiance
- Les tests d'hypothèses
- Les modèles semi-logarithmiques et réciproques

Le modèle de régression multiple

- Le problème de l'estimation
- Géométrie des MCO
- Tests d'hypothèses sur les coefficients
- Tests de stabilité des paramètres
- Les variables muettes

Assouplissement des hypothèses du modèle classique

- La multicolinéarité des régresseurs
- La spécification du modèle
- L'hétéroscédasticité
- L'autocorrélation

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- - Estimer un modèle de régression.
- - Tester des hypothèses.
- - Interpréter les résultats.

MODALITÉS D'ORGANISATION

- - 8 séances de 3h de cours
- - 6 séances de 2h de TD

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

Gujarati, Basic Econometrics

Stock et Watson, Introduction to Econometrics

Wooldridge, Introductory Econometrics

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 36 heures
- Cours magistraux: 24 heures
- Travaux dirigés: 12 heures

CODES APOGÉE

- BFIA03C [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)



Dernière modification le 11/12/2023