

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 auto-corrélation 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 auto-corrélation 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

CT (50%)

CC (50%)

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*,

Contact(s)

> Patricia Maissant renou

Responsable pédagogique
patricia.mr@parisnanterre.fr