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