

Économétrie 1

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 cinquième 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 : 5E5ECEMT
- > En savoir plus : UFR SEGMI <https://ufr-segmi.parisnanterre.fr/>

Présentation

- **Chapitre 1** : Développements Introductifs : Modèle et variable ; Rappels de statistique ; Concept de stationnarité.
- **Chapitre 2** : Le modèle de régression simple : Les moindres carrés ordinaires (MCO) ; Tests sur les paramètres de régression ; Analyse de la variance et coefficient de détermination ; Prévision ; Application empirique.
- **Chapitre 3** : Le modèle de régression multiple : Ecriture du modèle sous forme matricielle ; Les estimateurs des MCO ; Tests sur les coefficients de régression ; Analyse de la variance et coefficient de détermination corrigé ; Prévision ; Critères de comparaison de modèles ; Application empirique.

Objectifs

L'objectif du cours est de fournir aux étudiants les bases de l'économétrie. Chaque exposé théorique est

illustré par de nombreux exemples, ainsi que par des applications empiriques réalisées à partir des logiciels économétriques existants. L'étudiant qui le souhaite pourra reproduire lui-même ces applications à l'aide des données mises à disposition sur la page web de l'enseignant.

Évaluation

SESSION 1 :

Contrôle Terminal

• Type : Écrit

• Durée : 2h00

Régime Dérégatoire

• Type : Écrit

• Durée : 2h00

SESSION 2 :

• Type : Écrit

• Durée : 2h00

Utilisation de l'intelligence artificielle :

Le recours à l'IA est strictement interdit en vertu de la charte des examens qui prévoit que "pour les épreuves en présentiel : l'usage de téléphones portables, d'objets connectés, de casques audio, d'écouteurs ou de tout autre moyen de communication, même à l'usage d'horloge, permettant notamment la consultation de documents non autorisés et/ou la communication avec une tierce personne, est strictement interdit".

Pré-requis nécessaires

Connaissance des statistiques descriptives et de la théorie des tests statistiques.

Compétences visées

Maîtrise des techniques de base de l'économétrie : estimation par la méthode des moindres carrés ordinaires, tests sur les coefficients des modèles de régression, tests sur les résidus, analyse de la variance, prévision.

Bibliographie

- MIGNON, V. (2022), Econométrie. Théorie et applications. Economica (deuxième édition).

Contact(s)

> Valerie Mignon

Responsable pédagogique
mignon@parisnanterre.fr