

Master
Mathématiques Appliquées et Statistiques
M1 - IREF

Introduction à l'économétrie
[UE Econométrie I]




(24h)

Marc-Alexandre Sénégas (17h)

Anissa Saumtally (7h)

Responsable cours :

Marc-Alexandre Sénégas

-  Bureau : E326b
-  : marc-alexandre.senegas@u-bordeaux.fr
-  : <http://senegas.u-bordeaux4.fr/>

Cours :

→ Initier à la pratique de l'économétrie (spécification, estimation, tests).

→ Applications sous le logiciel R 

Orientations bibliographiques

DORMONT B., 2007, *Introduction à l'économétrie*, 2^{ème} éd., Montchrestien.

GREENE W. (2011), *Econometric Analysis*, 7th ed., Pearson Education,

KLEIBER Ch. & A. ZEILEIS (2008), *Applied Econometrics with R*, Springer-Verlag, New York

Plan :

- Définition et finalités de l'économétrie ; démarche ; spécification économétrique ; modèle de régression linéaire multiple.
- Estimateur des moindres carrés ordinaires (MCO) ; Estimateur du Maximum de Vraisemblance ; propriétés statistiques.
- Indicateurs d'adéquation d'une régression linéaire (R^2 / R^2 partiels) ; prévisions et prédictions
- Inférence statistique : tests sur les coefficients (Student, restrictions linéaires) ; tests de spécification (Ramsey ; variables omises)
- Miscellanées : tests de rupture ; Variables muettes ; perturbations non scalaires.