

# Introduction à l'économétrie

Ce cours vous est proposé par Olivier BARON, Maître de conférences, Université de Bordeaux et par AUNEGe, l'Université Numérique en Économie Gestion.

## À propos du cours

Ce cours est composé de **3 chapitres** découpé en sections. Chaque chapitre contient le **COURS ÉCRIT**, des **VIDÉOS EXPLICATIVES**, une **ILLUSTRATION** ou **ÉTUDE DE CAS** et des **exercices corrigés**.

Le cours écrit, les énoncés et corrections des quiz et exercices sont consultables et téléchargeables au format PDF.

Une présentation de l'auteur est consultables et téléchargeable au format PDF.

**Nous vous invitons à étudier les COURS, effectuer ensuite les QUIZ et/ou les ÉTUDES DE CAS pour tester vos connaissances.**

## Objectifs généraux du cours

Ce cours vise à présenter les résultats essentiels en économétrie linéaire en mixant les éléments théoriques et la pratique.

Les logiciels utilisés seront Eviews et Stata.

**Prérequis** : connaître l'algèbre linéaire et les statistiques inférentielles de base. Cependant des rappels seront effectués régulièrement.

## Plan du cours

### CHAPITRE 1 : Le modèle linéaire multiple

Section 1 : Écriture du modèle et notations

Section 2 : Les hypothèses du modèle

Section 3 : Estimation par moindres carrés ordinaires (MCO)

Section 4 : Propriétés statistiques des MCO à distance finie

Section 5 : Conséquences de l'hypothèse de normalité des perturbations

## CHAPITRE 2 : Tests usuels sur le modèle linéaire

Section 1 : Résultats préliminaires

Section 2 : Tests sur la valeur d'un coefficient – Tests de significativité

Section 3 : Test sur la valeur du vecteur  $\beta$

Section 4 : Contraintes linéaires sur les coefficients : estimation et tests

Section 5 : Le test de Chow : présentation et extensions

## CHAPITRE 3 : Méthode des MCO en présence d'hétéroscédasticité ou d'autocorrélation des perturbations

Section 1 : Introduction

Section 2 : Hétéroscédasticité des perturbations

Section 3 : Autocorrélation des perturbations

## Métadonnées

### Publics cibles

Le cours s'adresse à des étudiants en licence de L3 et en master M1.

### Domaines

Économie.

### Mots-clés

Économétrie, modèle linéaire, moindres carrés ordinaires, test de Chow, hétéroscédasticité, autocorrélation.

### Durée en équivalent heures de cours

30 heures.

### Auteur

Olivier Baron Maître de conférence en sciences de gestion, Université de Bordeaux.

### Edition

AUNEGe.

# Références

## Comment citer ce cours ?

Introduction à l'économétrie, Olivier BARON, AUNEGe (<http://auneg.fr>), CC – BY NC ND (<http://creativecommons.org/licenses/by-nc-nd/4.0/>).



Cette œuvre est mise à disposition dans le respect de la législation française protégeant le droit d'auteur, selon les termes du contrat de licence Creative Commons Attribution - Pas d'Utilisation Commerciale - Pas de Modification 4.0 International (<http://creativecommons.org/licenses/by-nc-nd/4.0/>). En cas de conflit entre la législation française et les termes de ce contrat de licence, la clause non conforme à la législation française est réputée non écrite. Si la clause constitue un élément déterminant de l'engagement des parties ou de l'une d'elles, sa nullité emporte celle du contrat de licence tout entier.