

## **Cours de Statistique-Econométrie**

Cours 1 (27/01/2026)

- [Slides](#)
- Exercice 1 :
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
  - o Code du tuto fait en cours ([script .R](#))

Cours 2 (03/02/2026)

- [Slides](#)
- Exercice 2 (régressions linéaires) :
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
  - o Code du tuto fait en cours ([script .R](#))
- Exercice 3 (régressions multiples) :
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
  - o Code du tuto fait en cours ([script .R](#))

Cours 3 (10/02/2026)

- [Slides](#)
- Exercice 4 (event studies) :
  - o Données à télécharger ([BaseTD1.csv](#))
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
- Exercice 5 (Capital Asset Pricing Model) :
  - o Données à télécharger ([CAPM.csv](#))
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))

Cours 4 (17/02/2026)

- [Slides](#)
- Exercice 6 (homoscédasticités et autocorrélation des erreurs) :
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
- Exercice 7 (boucles) :
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))

Cours 5 (24/02/2026)

- [Slides](#)
- Exercice 8 (régression multiple avec l'Arbitrage Pricing Theory) :
  - o Données à télécharger ([Microsoft.csv](#))
  - o Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
  - o Code du tuto fait en cours ([script .R](#))
- Pour aller plus loin sur les biais de variables omises, voir ce [tuto sur mon site](#), sur la reproduction intergénérationnelle du niveau d'éducation.

Contrôle terminal : présentation de 30 minutes + 5 minutes de questions, réparties sur les 3 dernières séances.

Ordre de passage :

Date de passage	Nom	Prénom	Groupe
07/04/2026	ROUX	CORENTIN	5
07/04/2026	FAROUQI	SOUFIANE	5
07/04/2026	AIT-OUAMARA	YANIS	5
07/04/2026	BORDES	JULIETTE	7
07/04/2026	ABITBOL	ANOUK	7
14/04/2026	HENRION	MARGAUX	3
14/04/2026	LAPEYRE	ROSIE	3
14/04/2026	KRIEF	RAPHAEL	6
14/04/2026	TAIEB	SACHA	6
14/04/2026	LEGENDRE	ELOUAN	8
14/04/2026	ADUAYOM	FOLLIVI ALEXANDRE	8
21/04/2026	HAMADACHE	ADAM	1
21/04/2026	FAUCON	LILIAN	1
21/04/2026	RAJCOOMAR--RAYAR	ROMAIN	1
21/04/2026	BOSI	EMMA	2
21/04/2026	RAVIER	LAURENZA	2
21/04/2026	NGUYEN	NGOC TU MINH	4

Liste des projets :

Groupe	Sujet
1 Adam, Lilian, Romain	Quel est l'effet de la détention d'ETF sur la volatilité d'un actif financier ?
2 Emma, Laurenza	L'indice de la peur : l'attention des investisseurs sur Wikipédia prédit-elle la volatilité des marchés ?
3 Margaux, Rosie	Dans quelle mesure le niveau de vie d'un individu influence-t-il la part de son budget consacrée à l'habillement ?
4 Tù	Comment la température quotidienne influence-t-elle la consommation d'électricité selon les régions en 2025 ?
5 Corentin, Soufiane, Yanis	La divergence entre la volatilité du S&P 500 et le VIX influence-t-elle la rentabilité annuelle du S&P 500 ?
6 Raphael, Sacha	
7 Juliette, Anouk	Quel est l'effet de l'éducation sur le salaire en France ?
8 Elouan, Alexandre	Quel est l'effet de la corruption sur le PIB ou la croissance ? Focus exploitation des ressources naturelles.