

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 Consignes et code ([fichier .html](#) ; [fichier .Rmd](#))
 - o Données à télécharger ([Microsoft.csv](#))
- 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 | |