

# Introduction à l'économétrie appliquée —

## Accueil

Pierre Beaucoral

2025-09-15

### Bienvenue

Bienvenue sur le site du cours **Introduction à l'économétrie appliquée** dispensé en **Licence 3 – École d'Économie (Université Clermont Auvergne)**.

Ce site rassemble **toutes les ressources nécessaires** pour suivre le cours : syllabus, supports de TD, corrigés, jeux de données et références bibliographiques.

---

### Objectif du cours

Ce cours initie les étudiants aux **méthodes économétriques de base** utilisées en analyse économique.

À l'issue de la formation, vous serez capable de :

- **Estimer** un modèle de régression linéaire et en interpréter les résultats ;
  - **Vérifier** les hypothèses classiques (normalité, homoscédasticité, autocorrélation, exogénéité) à l'aide de **tests statistiques** ( $t$ ,  $F$ , Jarque–Bera, Durbin–Watson, Breusch–Godfrey, Breusch–Pagan, White, Hausman) ;
  - **Corriger** les problèmes rencontrés (Moindres Carrés Généralisés, corrections de White, Cochrane–Orcutt) ;
  - Mettre en œuvre les **variables instrumentales (2SLS)** et interpréter les tests de sur-identification (Sargan) .
-

## Organisation

- **Volume horaire** : 30 heures (cours + TD)
  - **Prérequis** : bases de statistique (estimateurs, intervalles de confiance)
  - **Modalités** :
    - Cours magistraux.
    - Travaux dirigés en salle informatique avec manipulation de données réelles.
    - Évaluation : examen final.
- 

## Ressources

- [Syllabus complet](#)
  - Notes de cours et **diapositives** disponibles après chaque séance.
  - Slides de rappel de cours et réponses aux questions dans la section **TD**.
- 

## Références principales

1. Araujo, Brun & Combes (2008), *Économétrie*, Bréal — chapitres 1–2.
  2. Wooldridge (2009), *Introductory Econometrics*.
  3. Greene (2008), *Econometric Analysis*.
- 

## Pour bien démarrer

- Installez **EViews** (ou un logiciel équivalent) pour pouvoir reproduire les exemples.
  - Téléchargez les **fichiers de données** sur l'ent.
  - Parcourez le [syllabus](#) pour connaître les objectifs, le plan du cours et les lectures recommandées.
-