

Syllabus

Syllabus du cours

Niveau : L3 — École d'Économie (UCA)

Volume : 30h — Cours d'introduction à l'économétrie appliquée

Contenu (résumé)

- Rôle de l'économétrie dans la science économique ; rappel sur les estimateurs
- Modèle linéaire (MCO) et conditions de validité
- Tests usuels : normalité (Jarque–Bera), autocorrélation (Durbin–Watson, Breusch–Godfrey), homoscédasticité (Goldfeld–Quandt, Breusch–Pagan, White), exogénéité (test de Hausman — principe Nakamura & Nakamura)
- MCG : corrections (White pour hétéroscédasticité ; Cochrane–Orcutt pour autocorrélation), test COMFAC
- Variables instrumentales (DMC / 2SLS), suridentification (Sargan)
- Variables muettes, polynômes (au carré), interprétation
- Simulations de Monte Carlo (principes)

Références

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

Document source: *Syllabus_econométrie.docx* (fourni par l'enseignant).