

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 avec démonstrations pratiques sous **EViews**.
 - Travaux dirigés en salle informatique avec manipulation de données réelles.
 - Évaluation : exercices de TD, mini-projets et 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** fournis dans la rubrique *Travaux dirigés*.
 - Parcourez le [syllabus](#) pour connaître les objectifs, le plan du cours et les lectures recommandées.
-