

Introduction à l'Économétrie

Public Cible	3ème Année, Licence Hautes Etudes Commerciales, IHEC Sousse.
Volume Horaire	42 Heures
Pré-Requis	Algèbre, statistique descriptive et inductive.
Objectifs et Acquis d'Apprentissage	<ul style="list-style-type: none"> ○ La formation a pour objectif d'introduire aux méthodes fondamentales de l'économétrie qui permettent de mesurer les relations entre les phénomènes économiques sur la base d'observation de faits réels. ○ donner un contenu empirique aux théories économiques afin de vérifier leur validité. ○ Comprendre les principes sur lesquels repose le modèle de régression linéaire multiple et interpréter les résultats obtenus.
Mode d'Évaluation	Examen écrit + Evaluation des travaux pratiques sur Eviews.
Approche Pédagogique	Cours magistral + Travaux dirigés avec des applications sur Eviews.
Contenu - Plan de Cours	<ol style="list-style-type: none"> 1. Introduction <ol style="list-style-type: none"> 1.1 Origine, définition et objectifs 1.2 La démarche économétrique 1.3 Types de données 2. Modèle linéaire simple <ol style="list-style-type: none"> 2.1 Hypothèses 2.2 Estimation par MCO 2.3 Estimation par maximum de vraisemblance 2.4 Interprétation des coefficients 3. Inférence statistique sur le modèle de régression linéaire simple <ol style="list-style-type: none"> 3.1 Propriétés des estimateurs MCO 3.2 Analyse de la variance et qualité d'ajustement 3.3 Tests d'hypothèses 3.4 Prévisions 4. Modèle de régression linéaire multiple <ol style="list-style-type: none"> 4.1 Ecriture du modèle 4.2 Hypothèses 4.3 Estimation par MCO 4.4 Analyse de la variance et qualité d'ajustement 4.5 Inférence statistique <ol style="list-style-type: none"> i. Loi des estimateurs ii. Tests d'hypothèses et sélection de modèles iii. Inférence sur le modèle global : significativité globale iv. Inférence sur un modèle contraint et tests v. Prévisions 5. Modèle linéaire général et quasi-général <ol style="list-style-type: none"> 5.1 Ecriture des modèles 5.2 Méthode d'estimation des Moindres Carrés Généralisés (MCG) 5.3 Méthode d'estimation des Moindres Carrés Quasi-Généralisés (MCQG) 5.4 Propriétés des estimateurs 5.5 Violation des hypothèses MCO <ol style="list-style-type: none"> i. Modèle avec hétéroscédasticité : détection, tests et estimation ii. Modèle avec autocorrélation des erreurs : tests et estimation
Éléments Bibliographiques	<ul style="list-style-type: none"> ● R. Bourbonnais (1998). Econométrie - Manuel et exercices corrigés. Dunod. ● Y. Dodge, V. Rousson (2004). Analyse de régression appliquée. Dunod. ● W. Greene (2011). Econométrie. Pearson.