

Pratique de l'économétrie

Infos pratiques

- > ECTS : 1.5
- > Nombre d'heures : 18.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +3
- > Période de l'année : Enseignement cinquième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > Code ELP : 4E50508

Présentation

Le cours de pratique de l'économétrie permet l'utilisation des outils d'analyse quantitative, permettant de vérifier l'existence de certaines relations entre des phénomènes économiques et de mesurer concrètement ces relations sur la base d'observations de faits réels. Pour cela, l'estimation du modèle de régression sera réalisée à la fois sous les hypothèses standards et en présence d'hétéroscédasticité, d'autocorrélation et de multicollinéarité.

Objectifs

Permettre aux étudiants d'appliquer le modèle de régression multiple à des données économiques et financières en les familiarisant aux langages R et Python en économétrie.

Évaluation

Session 1 :

- Formule standard : Évaluation sur dossier
- Formule dérogatoire :

Session 2 : Évaluation sur dossier

Pré-requis nécessaires

Bases en mathématique et statistique.

Compétences visées

Utilisation d'une base de données, estimations des modèles de régression et validation de modèles.

Bibliographie

- * Azaïs, J.-M., et Bardet, J.-M., Le modèle linéaire par l'exemple : Régression, Analyse de la variance et Plans d'expérience illustrés avec R, SAS et Splus. Dunod, 2006.
- * Greene, W. H., Econométrie, Pearson.
- * Wooldridge, J. Introduction à l'économétrie, Deboeck

Contact(s)

> **Antonia Lopez villavicencio**

Responsable pédagogique
alopezvi@parisnanterre.fr