


ECONOMÉTRIE 1

 ECTS
4 crédits

 Composante
UFR de
mathématiques
et
informatique
(UFR27)

 Volume
horaire
42h

 Période de
l'année
Automne

plugin.odf:CONTENT_PROGRAM_TAB01_TITLE

Virginie Delsart, Arnaud Rys et Nicolas Vaneecloo,
Économétrie théorie et application sous SAS. Septentrion,
2009.

Description

Objectifs:

Estimer les paramètres d'un modèle linéaire, expliquer les conditions pour que ces estimations soient de qualité, en mesurer le degré de précision, juger de la validité empirique des présupposés théoriques du modèle et indiquer les précautions d'emploi du modèle estimé.

Contenu du cours:

-- Régression linéaire simple : modèle et estimation, analyse de la variance, coefficient de détermination, test sur la nullité de la pente

-- Régression linéaire multiple : quatre formules fondamentales, colinéarité statistique, algorithmes de construction de modèle ne comprenant que des variables significatives, étude de cas

--Analyse de la variance : analyse de la variance à deux facteurs croisés, test de Fisher, test de Student

Références:

Jean-Marc Azaïs et Jean-Marc Bardet, Le modèle linéaire par l'exemple : Régression, Analyse de la variance et Plans d'expérience illustrés avec R, SAS et Splus. Dunod, 2006.