

# Econométrie

Code (31HU05MS) U3EC36, 4,5 ECTS, Semestre S6

**Prérequis :** Probabilités II (S5) **Évaluation :** Contrôle continu et examen final

**Mentions concernées :** MIASHS

**Horaires hebdomadaires :** 2 h CM + 2 h TD

## Objectifs

L'économétrie étudie les données issues de l'économie avec les outils des statistiques. Ce cours est une initiation au traitement des séries temporelles et à l'économétrie des cohortes.

## Programme

- modèle linéaire, ANOVA, traitement de variables qualitatives, mise en oeuvre des tests de Student et Fisher, sélection de modèle,
- analyse des séries temporelles, propriétés des estimateurs des moindres carrés, étude des tendances, de la saisonnalité et de l'autocorrélation des erreurs, séries autorégressives,
- données de panel, comparaison avec des données en coupes indépendantes, modèles à effets fixes : cas simple (panel à deux périodes) et cas général.