

Econométrie 1

 ECTS
6 crédits

 Composante
Faculté
d'Economie
de Grenoble
(FEG), UFR
Sciences de
l'Homme et
de la Société
(SHS)

 Période de
l'année
Automne (sept.
à dec./janv.)

- > **Langue(s) d'enseignement:** Français
- > **Forme d'enseignement :** Cours magistral
- > **Ouvert aux étudiants en échange:** Oui

Présentation

Description

L'économétrie est le domaine des sciences économiques qui s'intéresse à la mesure des phénomènes économiques dans le but de valider ou d'infirmer les modèles théoriques. Elle recourt à la statistique mathématique et de l'inférence statistique pour quantifier des paramètres structuraux importants (par exemple élasticités prix et revenu, propension marginale à consommer, disposition à payer).

Objectifs

L'objectif du cours est de présenter une introduction aux notions mobilisées en économétrie pour une connaissance commune d'outils économétriques fondamentaux. Il s'intéressera à la définition de l'économétrie, à sa méthodologie et il illustrera l'approche économétrique par des exemples économiques. Le but de ce cours sera de fournir les méthodes économétriques à ce type d'approche en donnant des détails nécessaires pour comprendre pourquoi et quand tel ou tel instrument est nécessaire.

Ce cours commence par l'introduction du modèle de régression linéaire simple afin de présenter les estimateurs des moindres carrés ordinaires, l'étude de leurs propriétés statistiques et leur utilisation pour la construction d'intervalles de confiance ou la mise en œuvre de tests. L'ensemble des notions qui ont été vues dans le cadre de la régression simple sera ensuite généralisé au

cadre du modèle linéaire ordinaire à plusieurs variables explicatives. Les applications empiriques seront mises en œuvre grâce à l'utilisation d'un logiciel économétrique afin de saisir l'influence des méthodes spécifiques, ainsi que leur interprétation au niveau économique.

Heures d'enseignement

Econométrie 1 - TD	TD	15h
Econométrie 1 - CM	CM	30h

Pré-requis recommandés

Cours d'économie, de mathématiques et statistiques/statistiques inférentielles

Bibliographie

Araujo C., Combes, J.L., Brun, J-F. (2008). *Econométrie*, 2nd édition, Bréal, Paris.

Wooldridge, J. (2015). *Introduction à l'économétrie*. Une approche moderne. De Boeck.

Avant de venir : Tipoe, E. Baecker, R. Doien Economics : Empirical Projects. The CORE team. « Doing Economics. ».

En ligne, accès 2022 : [🔗 https://www.core-econ.org/project/doing-economics/](https://www.core-econ.org/project/doing-economics/)

Infos pratiques

Contacts

Responsable pédagogique

ADELAIDE FADHUILE-CREPY

✉ adelaide.fadhuile@univ-grenoble-alpes.fr

Lieu(x) ville

› Grenoble

Campus

› Grenoble - Domaine universitaire