Économétrie 2

ECTS
6 crédits

Composante
Faculté d'Economie de Grenoble (FEG)

Période de l'année
Printemps (janv. à avril/mai)

Diplômes intégrant cet élément

- Licence Economie et gestion

Langue(s) d'enseignement: Français

Ouvert aux étudiants en échange: Oui

Présentation

Description

Un modèle de régression repose sur un certain nombre d'hypothèses qui permettent d'établir les propriétés des estimateurs choisis et d'effectuer de la prévision. Il est donc capital de contrôler en utilisant l'ensemble des données à disposition, si ces hypothèses sont bien vérifiées. On introduira quelques méthodes de diagnostic qui permettent de déceler si l'une ou l'autre des hypothèses n'est pas satisfaite. On apportera également quelques remèdes qui permettent d'adapter le modèle en conséquence.
Le cours présuppose une connaissance du cours d'Econométrie 1.

Heures d'enseignement

CM	CM	30h
TD	TD	15h

Période : Semestre 6

Bibliographie

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 30 juin 2026

DROESBEKE J.J., LEJEUNE M., SAPORTA G., Modèles statistiques pour données qualitatives, Editions Technip, Paris, 2005.

DODGE Y., ROUSSON V., Analyse de régression appliquée, Dunod, Paris, 2004.

GUJARATI D., Basic Econometrics. McGraw Hill, New York.

NETER J. W., WASSERMANN W., Applied Linear Statistical Models, Homwood, Illinois, Irwin, 1985.

Infos pratiques

Lieu(x) ville

Grenoble

Campus

Grenoble - Domaine universitaire

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 30 juin 2026