**SYLLABUS COURS MAGISTRAL**

**ECONOMETRIE 2**

**MASTER RECHERCHE 1 (Sciences économiques et de gestion)**

Année académique / Academic year : 2018-2019

**Christian Lambert NGUENA,**

**Agrégé des Universités**

**Contact:** [**lambert.nguena@univ-dschang.org**](mailto:lambert.nguena@univ-dschang.org)

**Objectif du cours :** Présenter clairement les principales méthodes économétriques (application des mathématiques et des statistiques à la théorie économique) et expliquer en détail comment les utiliser en pratique pour comprendre les phénomènes économiques. Ce cours se distingue par l'abondance des études de cas exposées, qui utilisent systématiquement des données réelles et qui portent aussi bien sur des problématiques d'entreprise que sur des problématiques financières ou macroéconomiques. Ce cours constitue donc un outil particulièrement utile à la formation en économétrie des étudiants en sciences de gestion comme en sciences économiques.

Le cours se distingue également par la place qu'il accorde à expliquer comment les modèles sont spécifiés pour différents types d'applications. L'enseignement de l'économétrie se concentre trop souvent exclusivement sur les techniques d'estimation des modèles, sans détailler au préalable les méthodes de spécification de ces modèles. Or, dans la pratique, la validité d'une étude économétrique dépend de la pertinence de la spécification du modèle estimé ; il est vain de connaître les différentes méthodes d'estimation et d'inférence statistique si on les applique à des modèles incohérents.

**Pré requis :** Econométrie 1; Statistiques; Mathématiques et Théorie économique.

**Méthodes pédagogiques :** Remise préalable du support de cours aux étudiants.

**Lieu de formation** : Université de Dschang.

**Langue de formation :** Français et éventuellement anglais.

**PLAN INDICATIF**

**Chapitre 1** DE L’ECONOMIE A L’ECONOMETRIE : RAPPEL HISTORIQUE ET CONCEPTUEL

**Chapitre 2** MODELES DE REGRESSION NON LINEAIRES

**Chapitre 3** VIOLATION DES HYPOTHESES DE BASE

**Chapitre 4** PROCESSUS STOCHASTIQUE ET ABSENCE DE TREND : TESTS DE RACINE UNITAIRE ADF ET PHILLIPS-PERRON

**Chapitre 5** MODELES A EQUATIONS SIMULTANEES

**Chapitre 6** VARIABLES MUETTES

**Bibliographie indicative:**

William GREENE (2012): Econometric analysis, Pearson (7th edition);

Eric DOR (2009): Econométrie, Pearson education.