

PLAN

- Chapitre 1:
 - La méthode des MCO
- Chapitre 2 :
 - Propriétés Statistiques des MCO
 - Etude des résidus
 - Choix de modèles
- Chapitre 3 :
 - Tests de Normalité
 - Tests de Student et Fisher
 - Tests de Chow et instabilité des coefficients
 - Tests d'hétéroscédasticité
 - Tests d'autocorrélation
 - Traitement de l'autocorrélation
 - Révisions
 - Les résidus récursifs: test de von Neumann et test de Brown, Durbin et Evans
- Chapitre 4
 - Les modèles dynamiques : modèles à retards échelonnés et modèles autorégressifs
 - Exercices sur les modèles dynamiques
- Chapitre 5
 - Les séries non stationnaires. L'intégration des séries. les tests de Dickey et Fuller
 - Exercices
 - La cointégration
 - Exercices
- Chapitre 6
 - Les modèles à correction d'erreur
 - Les modèles V.A.R. et les VAR à correction d'erreur
- Chapitre 7
 - La colinéarité
 - La régression Ridge Ordinaire