

## 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