

## **1 CHAPITRE 1:**

La méthode des MCO  
Exercices

## **2 Chapitre 2 :**

Propriétés Statistiques des MCO  
Etude des résidus  
Choix de modèles  
Exercices

## **3 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  
Exercices  
Les résidus récurrents: test de von Neumann et test de Brown, Durbin et Evans

## **4 Chapitre 4**

Les modèles dynamiques : modèles à retards échelonnés et modèles autorégressifs  
Exercices sur les modèles dynamiques

## **5 Chapitre 5**

Les séries non stationnaires. L'intégration des séries. les tests de Dickey et Fuller  
Exercices  
La cointégration  
Exercices

## **6 Chapitre 6**

Les modèles à correction d'erreur

Les modèles V.A.R. et les VAR à correction d'erreur

Exercices

## **7 Chapitre 7**

La colinéarité

La régression Ridge Ordinaire

Exercices