

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