

TABLE DES MATIÈRES

PRÉFACE	7
----------------------	---

CHAPITRE 1

Introduction : Qu'est-ce que l'économétrie?	9
1.1 Brève histoire de l'économétrie	10
1.2 Les définitions de l'économétrie.....	11
1.3 Notions et concepts fondamentaux de l'économétrie	13
1.4 La place et le rôle de l'économétrie dans le système des sciences économiques.....	20

CHAPITRE 2

Les principaux types de modèles économétriques utilisés en économie	22
2.1 La description économétrique des dépendances et des interdépendances entre les phénomènes économiques	23
2.2 Les types principaux des modèles économétriques utilisés en l'économie	29

CHAPITRE 3

Le modèle de régression simple	45
3.1 La spécification et la définition du modèle de régression simple....	46
3.2 L'identification du modèle de régression simple	48
3.3 L'estimation des paramètres du modèle de régression simple.....	56
3.4 La vérification du modèle économétrique	65
3.4.1 La vérification des hypothèses sur lesquelles est fondée l'estimation des paramètres du modèle économétrique.....	65
3.4.2 La vérification de la signification des estimateurs des paramètres du modèle économétrique.....	82
3.4.3 La vérification de la signification du modèle économétrique	85
3.5 L'utilisation du modèle de régression simple.....	90

CHAPITRE 4

Le modèle de régression multiple	100
4.1 La spécification et la définition du modèle de régression multiple.....	101
4.2 L'identification du modèle de régression multiple	103
4.3 L'estimation des paramètres du modèle de régression multiple	105
4.4 Les hypothèses pour l'estimation des paramètres du modèle de régression multiple.....	114
4.5 La vérification de la signification du modèle de régression multiple	116
4.6 La simulation et la prévision du modèle de régression multiple.....	124

CHAPITRE 5

Les modèles à variables qualitatives	148
---	-----

CHAPITRE 6

Les modèles dynamiques	158
-------------------------------------	-----

CHAPITRE 7

Les modèles à équations simultanées	172
7.1 Bref historique concernant l'apparition et l'évolution des modèles à équations multiples	173
7.2 La forme structurelle et la forme réduite d'un modèle à équations simultanées	180
7.3 L'identification du modèle à équations simultanées.....	183
7.4 Les méthodes d'estimation des paramètres d'un modèle à équations simultanées	185
7.5 Exemples de modèles à équations simultanées.....	188
7.6 Les modèles récursifs.....	201
7.7 La simulation et la prévision des modèles à équations multiples.....	207

CHAPITRE 8

L'utilisation des logiciels en économétrie	216
8.1 Exemple d'application en utilisant le logiciel EXCEL	217
8.2 Exemple d'application en utilisant le logiciel SPSS	221

ANEXXES	226
----------------------	-----

BIBLIOGRAPHIE	241
----------------------------	-----