

Sommaire

Chapitre 1 : Le Modèle Linéaire Simple

- Hypothèses fondamentales et estimation par les Moindres Carrés Ordinaires (MCO).
- Propriétés des estimateurs et tests d'hypothèses sur les coefficients.
- Mise en œuvre sous SAS : La procédure `PROC REG`.

Chapitre 2 : Le Modèle de Régression Multiple

- Généralisation matricielle du modèle linéaire.
- Coefficient de détermination (R^2) et R^2 ajusté.
- Tests de significativité globale (Test de Fisher) et individuelle (Test de Student).

Chapitre 3 : Violation des Hypothèses et Diagnostics

- Multicolinéarité : Détection et remèdes.
- Hétéroscédasticité : Tests de White et de Goldfeld-Quandt.
- Autocorrélation des erreurs : Test de Durbin-Watson.
- Utilisation de la `PROC AUTOREG`.

Chapitre 4 : Variables Qualitatives et Ruptures

- Introduction de variables muettes (*Dummy variables*).
- Changement de structure et test de Chow.

Chapitre 5 : Introduction aux Séries Temporelles

- Processus stationnaires et tests de racine unitaire.
- Introduction aux modèles ARMA.