

- Faculté des sciences économiques
- www.unine.ch/seco

Econométrie appliquée (5ST1009)

Filières concernées	Nombre d'heures	Validation	Crédits ECTS
Bachelor en sciences économiques, orientation comptabilité/finance	Cours: 4 ph	écrit: 2 h	6
Bachelor en sciences économiques, orientation économie politique	Cours: 4 ph	écrit: 2 h	6
Bachelor en sciences économiques, orientation management	Cours: 4 ph	écrit: 2 h	6
Bachelor en sciences économiques, orientation ressources humaines	Cours: 4 ph	écrit: 2 h	6
Bachelor en sciences économiques, orientation systèmes d'information	Cours: 4 ph	écrit: 2 h	6

ph=période hebdomadaire, pg=période globale, j=jour, dj=demi-jour, h=heure, min=minute

Période d'enseignement:

- Semestre Printemps

Equipe enseignante:

Sylvain Weber
Faculté des sciences économiques, Pierre-à-Mazel 7, 2000 Neuchâtel
bureau 213
e-mail: sylvain.weber@unine.ch
tel: 032 718 14 42

Objectifs:

L'objectif de ce cours est d'apprendre à utiliser empiriquement les principales techniques utilisées en économétrie. Les modèles économétriques seront revus et discutés pendant les cours, sur la base d'articles lus en avance par les étudiants. Pendant les séminaires, les étudiants travailleront avec des données réelles et mettront en application les modèles économétriques à l'aide du logiciel Stata. Grâce à un projet de recherche individuel, les étudiants se confronteront à toutes les étapes du processus de recherche scientifique: définition de la question de recherche, collecte et traitement des données, spécifications et évaluation du modèle quantitatif, analyse des résultats. À l'issue du cours, les étudiants devraient être capables de mener à bien des recherches empiriques de manière autonome.

Contenu:

Le cours contiendra des discussions et applications des principales techniques économétriques, soit notamment:

- Régression des moindres carrés ordinaires
- Analyse des données de panel
- Régression binomiale
- Méthode des variables instrumentales

Forme de l'évaluation:

L'évaluation sera basée sur:

- le travail effectué lors des séminaires (20%)
- un projet de recherche individuel (40%)
- un examen final écrit de 2h durant la session d'examens de fin de semestre (40%)

Rattrapage examen écrit de 2h.

Documentation:

(Liste non-exhaustive)

- Asteriou, D. and Hall, S. G. (2011): "Applied Econometrics", 2nd edition, Palgrave MacMillan.
- Cameron, A.C. and Trivedi, P.K. (2005): "Microeconometrics: Methods and Applications", Cambridge University Press.
- Greene, W. (2011): "Econometric Analysis", 7th edition, Prentice Hall.
- Gujarati, D. (2011): "Econometrics by Example", Palgrave MacMillan.
- Hill, R.C., Griffiths, W.E., and Lim, G.C. (2008): "Principles of Econometrics", 3rd edition, John Wiley & Sons.
- Kohler, U. and Kreuter, F. (2005): "Data Analysis Using Stata", Stata Press.
- Stock, J.H. and Watson, M.W. (2007): "Introduction to Econometrics", 2nd edition, Pearson Education.

Des articles de revues scientifiques seront distribués aux étudiants.

Pré-requis:

- Faculté des sciences économiques
- www.unine.ch/seco

Econométrie appliquée (5ST1009)

Le cours "Économétrie" devrait être suivi avant le cours "Économétrie appliquée".

Forme de l'enseignement:

L'enseignement se compose de:

- 2h de cours.
- 2h de séminaire durant lequel les étudiants travailleront sur le logiciel Stata.