

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

Econométrie (5ST1001)

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

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

Période d'enseignement:

- Semestre Automne

Equipe enseignante:

Yves Tillé, Professeur, Institut de statistique Rue A.-L. Breguet 2, CH-2000 NEUCHATEL
+41 32 718 14 75 - yves.tille@unine.ch

Anastasiade Mihaela, assistante-doctorante, Institut de statistique Rue A.-L. Breguet 2, CH-2000 NEUCHATEL
+41 32 718 1399 - mihaela.anastasiade@unine.ch

Objectifs:

Approfondir seul ses connaissances en économétrie en lisant la littérature scientifique moderne sur ce sujet.

Contenu:

- Rappel d'Algèbre linéaire et de régression linéaire multiple.
- La non-adéquation des hypothèses du modèle linéaire général : autocorrélation des résidus, hétéroscédasticité.
- Le choix des variables, la théorie des modèles à équations simultanées et la régression sur variables qualitatives.
- Les éléments de modélisation des séries temporelles.

Forme de l'évaluation:

E: Examen écrit de 2 heures lors de la session d'examens de fin de semestre
Rattrapage : examen écrit de 2h.

Documentation:

Y. Tillé (2008), Résumé du cours d'économétrie, Polycopié du cours, disponible sur claroline.

Pré-requis:

Modèles de régression

Forme de l'enseignement:

2h cours 2h TP