

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

Econométrie (5ST1001)

Filières concernées	Nombre d'heures	Validation	Crédits ECTS
Bachelor en mathématiques	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Bachelor en sciences économiques, orientation comptabilité/finance	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Bachelor en sciences économiques, orientation économie politique	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Bachelor en sciences économiques, orientation management	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Bachelor en sciences économiques, orientation ressources humaines	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Bachelor en sciences économiques, orientation systèmes d'information	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Bachelor en systèmes naturels	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6
Pilier principal B A - économie	Cours: 2 ph TP: 2 ph	Voir ci-dessous	6

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

Période d'enseignement:

- Semestre Automne

Equipe enseignante:

Laurent Donzé
Chargé d'enseignement
Institut du Management de l'Information
Rue A.-L. Breguet 2, CH-2000 Neuchâtel
laurent.donze@unine.ch

Martina Raggi
Assistante-doctorante
Institut du Management de l'Information
Rue A.-L. Breguet 2, CH-2000 Neuchâtel
martina.raggi@unine.ch

Objectifs:

Ce cours d'introduction permettra à l'étudiant-e de comprendre et d'appliquer les méthodes de base de l'économétrie. L'étudiant-e pourra se familiariser durant les travaux pratiques avec les notions théoriques exposées durant le cours. L'étudiant-e pourra se confronter à différents problèmes d'estimation sur la base de nombreuses bases de données. Il-Elle pourra également apprendre ou approfondir ses connaissances du logiciel statistique R. Enfin, il-elle pourra mettre en oeuvre ses connaissances dans l'élaboration d'un projet (optionnel) de groupe. Au terme du cours, l'étudiant-e disposera non seulement des connaissances nécessaires pour comprendre un cours avancé (niveau master) d'économétrie, mais aussi d'un savoir-faire utile pour l'analyse économétrique de base.

Contenu:

1. Introduction à l'analyse de régression
2. Le modèle classique de la régression linéaire
3. Analyse des résidus, diagnostics et mesures d'influence
4. Modèles de régression généralisée, hétéroscédasticité et autocorrélation

Forme de l'évaluation:

EI: Evaluation de projet (optionnel) en fin de semestre (pondération dans la note finale: 1/5).

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

Econométrie (5ST1001)

E: Examen écrit durant la session d'examens de fin de semestre (pondération dans la note finale: 4/5)

Le projet sera évalué "réussi" ou "non réussi". Si le projet est réussi, il obtiendra la note 6. En cas de non-réussite, aucune note ne sera donnée au projet et seule comptera dans la note finale, la note de l'examen. il n'y a pas de possibilité d'effectuer un projet hors semestre.

Rattrapage : examen écrit de 2 heures en session.

Aucun document ou objet connecté n'est admis dans les examens.

En cas d'infraction à ces règles, les étudiant-e-s sont en situation de "fraude" et les éléments non admis seront retirés. L'examen pourra être réputé échoué.

Documentation:

Le cours est accompagné d'un script et soutenu par la plate-forme moodle et le serveur de calepins Jupyter Hub. Une bibliographie générale est donnée aux étudiant-e-s en début de cours.

Pré-requis:

Statistique descriptive, Statistique Inferentielle, Statistical Learning

Forme de l'enseignement:

2h cours, 2h TP