UCLouvain

lecge1335

2018

Econométrie appliquée

5 crédits	30.0 h + 15.0 h	Q2

Enseignants	Bennala Nezar (supplée Gao Zhengyuan) ;Van Bellegem Sébastien ;
Langue d'enseignement	Français
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Thèmes abordés	Le cours part de l'application des outils de base de l'économétrie avec des exemples pratiques de modèles économiques les plus courants. L'étudiant verra ensuite, à travers l'application des approches diverses à la modélisation de séries temporelles, les problèmes liés à la reconnaissance de résultats apparemment significatifs mais sans contenu réel. Certains outils plus avancés mais essentiels seront aussi abordés. La connaissance de base d'un logi-ciel économétrique est un pré-requis de ce cours. Mais l'étudiant continuera l'apprentissage des méthodes spécifi-quement liées au contenu de ce cours à travers des travaux pratiques.
Acquis d'apprentissage	1 Le cours est un prolongement naturel du cours "Économétrie : ECGE1316". L'objectif principal est d'approfondir et d'étendre la formation dans des domaines de la modélisation économétrique. Un accent particulier est mis sur les problèmes spécifiques à la modélisation des séries temporelles, en partant des méthodes enseignées dans le cours "Économétrie". - - - - *La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».*
Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Evaluation : Il y aura un examen écrit, mais la participation des élèves à la préparation des séances hebdomadaires ainsi qu'aux travaux pratiques formeront aussi un part très important de l'évaluation. Les points liés à ces travaux ne peuvent être obtenus qu'en participant activement aux cours et aux travaux pratiques. Les parts relatifs à l'examen écrit et aux travaux pratiques seront précisés en début du quadrimestre.
Contenu	Contenu : Les modèles dynamiques et leurs propriétés et problèmes particuliers. Le problème de la non-stationnarité des séries économiques. Tests de stationnarité. La notion de la cointégration et les modèles à correction d'erreurs. Tests de cointégration. Introduction à la méthode de maximum de vraisemblance avec application à l'estimation de modèles avec variable dépendante qualitative. Méthode : Le cours est organisé de façon à guider l'apprentissage personnel des élèves (y compris avec un logiciel). Les élèves préparent chaque cours par des lectures préalables, guidées par des questions sur une problématique économique. Chaque séance de cours a pour but de discuter la matière, notamment en répondant aux questions qui ont servi de guide, mais aussi toute autre question, et de synthétiser la matière. Les séances seront donc présentés par des groupes d'étudiants.
Bibliographie	Support : Ouvrage de référence (à titre d'exemple) R.L. Thomas (1996), Modern Econometrics: an introduction. Addison-Wesley.
Autres infos	Pré-requis : cours d'Econométrie du BAC ECGE1316
Faculté ou entité en charge:	ESPO

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)

Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Approfondissement en économie	LECON100P	5		