

2.00 crédits	15.0 h	Q1
--------------	--------	----

Langue d'enseignement	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables	Formation de base en mathématiques.
Thèmes abordés	Pour la partie de mathématiques, algèbre matricielle, fonctions, optimisation, équations en différences et différentielles. Pour la partie statistique: distributions multivariantes et sujets proches. Les deux parties sont liées en particulier par l'algèbre matricielle.
Acquis d'apprentissage	
Méthodes d'enseignement	Cours magistraux et devoirs
Contenu	<p>Mathématiques : algèbre matricielle (matrice inverse, rang, dérivée, valeurs propres, diagonalisation et factorisation, formes quadratiques). Espaces métriques et topologiques, Espaces vectoriels. Fonctions réelles sur R^n (continuité, concavité, différentiabilité, expansion de Taylor, théorème de la valeur moyenne, théorème de la fonction implicite). Optimisation statique (sans et avec contraintes). Equations en différences et différentielles (états stationnaires, stabilité).</p> <p>Statistique: distributions multivariantes: distributions jointe, marginale et conditionnelle, moments conditionnels (matrices de variances-covariances), indépendance en probabilité et indépendance linéaire. Loi de espérances itérées. Transformation de vecteurs aléatoires. Distribution normale multivariante. Formes quadratiques sur vecteurs de variables normales et distributions liées (Student, chi-squared, Fisher)</p>
Autres infos	Examen écrit.
Faculté ou entité en charge:	ECON

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)				
Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master [120] en sciences économiques, orientation économétrie	ETRI2M	2		