

Faculté des sciences économiques, sociales et politiques

ECGE1326 **Econométrie appliquée**

[22.5h] 3 crédits

Ce cours n'est pas dispensé en 2005-2006

Langue d'enseignement : français

Niveau : Premier cycle

Objectifs (en termes de compétences)

Le cours est un prolongement naturel du cours "Économétrie". 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".

Objet de l'activité (principaux thèmes à aborder)

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. L'apprentissage d'un logiciel économétrique fait partie intégrale de ce cours.

Résumé : Contenu et Méthodes

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

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.

Autres informations (Pré-requis, Evaluation, Support, ...)

Pré-requis : cours d'Econométrie du BAC ECGE

Support : Ouvrage de référence (à titre d'exemple) R.L. Thomas (1996), Modern Econometrics: an introduction. Addison-Wesley.