

ECN-14758 Introduction à l'économétrie

Syllabus du cours

Matériel pédagogique

Jeffrey M. Wooldridge, Introductory Econometrics: A Modern Approach, Thomson South-Western, U.S.A.

Acétates utilisées dans le cours

Les objectifs du cours

Ce cours offre une introduction rigoureuse à la régression linéaire en économie. Une attention particulière sera portée à la mise en application des techniques présentées à l'aide du logiciel STATA. Nous considérerons les sujets suivants (en ordre de présentation):

- Principaux concepts en probabilité (Wooldridge, Annexe B)
- Régression linéaire bivariée (Wooldridge, Chap 1-2)
- Revue de l'algèbre matricielle (Wooldridge, Annexe D)
- Régression linéaire multivariée (Wooldridge, Chap 3-7 et Annexe E)
 - Estimation
 - Inférence
 - Variables qualitatives
- Non-sphéricité des erreurs
 - Hétéroscédasticité (Wooldridge, Chap 8)
 - Autocorrélation (Wooldridge, Chap 12)

L'évaluation

► Travaux pratiques (20%)

- Travail I, (10%), Concepts de probabilité et régression linéaire bivariée. Distribué le 24 septembre, à remettre le 15 octobre.
- Travail II, (10%), Algèbre matricielle, régression linéaire multivariée, et non-sphéricité des erreurs. Distribué le 5 novembre, à remettre le 26 novembre.

► Examen Intra (40%), le 22 octobre 2008 à l'heure du cours.

► Examen Final (40%), le 10 décembre 2008 à l'heure du cours.

Horaire et modalités du cours

Cours: Mercredi 15h30-18h30 au 0224 Pavillon J. A. de Sève
Dépannages: Mardi 9h00-11h00 au 0128 Pavillon J. A. de Sève

Formule pédagogique

Le cours est organisé en séances de cours magistraux et de dépannages. Les dépannages seront donnés par Myra Yazbeck (myazbeck@ecn.ulaval.ca). Son local est le DES-2245.

Initiation au logiciel STATA

Le langage STATA sera utilisé pour ce cours. Il sera disponible dans les laboratoires du département. Il est possible de se procurer une version personnelle (non gratuite) via le site web suivant : <http://www.stata.com>. Les documents, exemples et données qui seront utilisés pour appuyer le cours seront disponibles sur le site du cours via WebCT <http://www.webct.ulaval.ca>. Toute l'information pertinente au cours sera aussi transmise à travers ce site.

Évaluation des apprentissages

La note finale dans le cours sera convertie dans une cote selon le barème suivant:

93,0 - 100 : A+
88,0 - 92,9 : A
83,0 - 87,9 : A-
79,0 - 82,9 : B+
75,0 - 78,9 : B
72,0 - 74,9 : B-
69,0 - 71,9 : C+
66,0 - 68,9 : C
63,0 - 65,9 : C-
60,0 - 62,9 : D+
55,0 - 59,9 : D
0 - 54,9 : E (échec)
