

GPL - 3001

Régression et corrélation

Description
Responsable
Syllabus
Exercices
Matériel de cours
Ressources
Travail de session

Syllabus

Objectifs du cours

L'objectif du cours est de vous familiariser avec les principaux outils de la régression. Ces outils vous seront d'une grande utilité dans la plupart de vos cours et vous aideront également à mieux comprendre le monde chiffré de plus en plus complexe qui nous entoure.

Démarche pédagogique

Le cours a été développé dans le but de favoriser l'apprentissage de façon autonome. Certaines des notions que nous étudierons vous sont probablement étrangères en ce moment. Certaines d'entre elles sont par ailleurs relativement abstraites. L'enseignement a été conçu en fonction de ces particularités.

L'expérience d'enseignement nous a aussi appris que la réussite d'un cours d'économétrie exige une assuidité sans faille et un rythme de travail constant. Vous devrez planifier vos activités d'études en fonction du calendrier qui est proposé ci-après.

Manuel du cours

Le cours utilise la manuel suivant: Humberto Barreto et Frank M. Howland, *Introductory Econometrics (Using Monte Carlo Simulation with Microsoft Excel)*, Cambridge, 2006

Le site du livre se situe à l'adresse suivante: <http://www3.wabash.edu/econometrics/>. Le site contient de nombreuses informations utiles, des macros Excel, des corrigés d'exercices, etc.

Évaluation

L'évaluation du cours portera sur un examen de mi-session et un travail de session individuel. La pondération est la suivante:

Évaluation	Pondération	Date
Mi-session	45%	20 octobre
Travail de session	55%	À remettre avant le 15 décembre

Calendrier des cours

Thème	Chapitre(s)	Semaine
Introduction		
Concepts de base	1,2 et 3	1 septembre
Les moindres carrés ordinaires		
L'estimation de la droite de régression	4	8 septembre
Interprétation de la droite de régression	5	15 septembre
La régression multiple	7	22 septembre
Les variables dichotomiques	8	29 septembre
Inférence statistique		
Simulations Monte-Carlo	9	6 octobre
Inférence statistique	10	13 octobre
Examen de mi-session		20 octobre
Semaine de lecture		27 octobre

Les écart-types et les intervalles de confiance	15 et 16	3 novembre
Tests d'hypothèses joints	17	10 novembre
Biais de variables omises	18	17 novembre
Hétéroscédasticité	19	24 novembre
Autocorrélation	20	1 décembre
Variable dichotomique endogène	22	8 décembre
Remise du travail de session		15 décembre

Coordonnées: Guy.Lacroix@ecn.ulaval.ca