

PLAN DE COURS

ECN-6025 : Économétrie I

NRC 84443 | Automne 2024

Formule d'enseignement : Présentiel

Temps consacré : 3-0-6 Crédit(s) : 3

L'objectif de ce cours est de transmettre la connaissance des principaux outils économétriques à l'étudiant. Ces outils sont nécessaires à la compréhension des développements récents qui sont étudiés dans des cours spécialisés. L'étudiant doit connaître les concepts de base du modèle linéaire classique.

Cette section de cours est offerte en présence.

Plage horaire

Cours en classe			
jeudi	12h30 à 15h20	CSL-1516	Du 3 sept. 2024 au 13 déc. 2024

Il se peut que l'horaire du cours ait été modifié depuis la dernière synchronisation avec Capsule. [Vérifier l'horaire dans Capsule](#)

Site de cours

<https://sitescours.monportail.ulaval.ca/ena/site/accueil?idSite=167932>

Coordonnées et disponibilités

Bruce Shearer
Enseignant
Pavillon de Sève, 2290
bruce.shearer@ecn.ulaval.ca

Boubacar Kaba
boubacar.kaba.1@ulaval.ca

L'Université reconnaît le droit à la déconnexion des professeures et professeurs, des personnes chargées de cours et des autres membres du personnel enseignant. Cela signifie que ces personnes ne sont pas tenues de consulter les messages qui leur sont envoyés (courriel, boîte vocale, message dans un forum, etc.) pendant les soirs, fins de semaine, jours fériés et vacances. La personne qui aura envoyé un message durant ces périodes devra donc s'attendre à recevoir une réponse dans un délai raisonnable, calculé à partir de la reprise des heures normales de travail.

Soutien technique

CSTIP - Centre de services en TI et pédagogie

Pavillon Charles-De Koninck, local 0248

aide@cstip.ulaval.ca

Téléphone :

418-656-2131 poste 405222

418-656-5222

Informations techniques importantes

[Équipez-vous pour réussir](#)

[Accéder à l'horaire du CSTIP](#)

[Liste des navigateurs supportés](#)

Avis important concernant les appareils mobiles [\(iOS, Android, Chrome OS\)](#)

[TeamViewer](#) est l'application utilisée par le CSTIP pour faire du soutien à distance. En exécutant cette application, vous permettez à un agent de soutien informatique de se connecter à votre poste pour vous aider.

Plateformes de vidéoconférence institutionnelles

Voici l'information essentielle pour vous connecter à l'une ou l'autre de nos plateformes de vidéoconférence institutionnelles.

[Microsoft Teams ULaval](#)

[Zoom ULaval](#)

Sommaire

Description du cours	4
Objectifs généraux	4
Objectifs spécifiques	4
Contenu du cours	4
Approche pédagogique	4
Contenu et activités	4
Évaluations et résultats	5
Liste des évaluations	5
Informations détaillées sur les évaluations sommatives	5
Intra	5
Examen final (cumulatif sur toute la session)	6
Travail pratique 1	6
Travail pratique 2	6
Barème de conversion	6
Règlements et politiques institutionnels	6
Politique à l'égard des retards aux évaluations	7
Politique en matière d'absence aux évaluations	7
Étudiants ayant une situation de handicap liée à une limitation fonctionnelle	7
Matériel didactique	8
Liste du matériel obligatoire	8
Liste du matériel complémentaire	8
Bibliographie et annexes	8
Bibliographie	8

Description du cours

Objectifs généraux

Ce cours vise à développer la connaissance de l'économétrie à un niveau gradué. Le matériel du cours sera basé sur le manuel de Greene (Économétrie), sans toutefois le suivre à la lettre. Les notes du cours qui sont complémentaires au manuel seront disponibles pour les étudiants sur le portail du cours.

Objectifs spécifiques

Assurer une connaissance des modèles et des outils économétriques fondamentaux aux étudiants inscrits aux études graduées en économique. Comme préalable, les étudiants devraient avoir suivi un cours d'algèbre matricielle, un cours de statistique et un cours d'économétrie (tous au baccalauréat). Les étudiants qui n'ont pas les prérequis sont responsables de leur mise à niveau.

Contenu du cours

Il y aura deux travaux pratiques à compléter par les étudiants. Ces travaux comprennent des exercices théoriques et pratiques qui nécessitent l'analyse de données et de la programmation. Les étudiants peuvent se servir de Stata ou de R pour leurs travaux pratiques.

Veillez prendre connaissance des règles institutionnelle concernant le plagiat: <https://www.bda.ulaval.ca/vous-etes-etudiants/plagiat/> .

Notez également que toute utilisation de ChatGPT (ou l' équivalent) est interdite pour ce cours et ses évaluations.

Une séries d'exercices sera disponible sur la page web.

Il y aura des dépannages les vendredis entre 12h30 et 15h20 pour réviser les exercices. Ces dépannages auront lieu dans le local CSL-4275. Le premier dépannage sera le 13 septembre et d'autres depannages suivront à un rythme déterminé par le depanneur et les étudiants.

Approche pédagogique

Le cours sera donné en présentiel. Les notes de cours seront disponibles sur le site du cours. Ces notes devront être considérées comme un support pour le manuel de Greene. Elles vous sont fournies pour vous aider à comprendre le manuel, ou d'autres livres en économétrie. Elles ne sont pas un substitut pour ces livres et ne doivent pas être citées pour soutenir vos démarches en économétrie, pour compléter votre mémoire, votre thèse, ou d'autres travaux de recherche.

Notez que le format du cours peut être changé selon l'évolution de la pandémie.

Contenu et activités

Le tableau ci-dessous présente les semaines d'activités prévues dans le cadre du cours.

Titre	Date
0. Révision mathématique	
Introduction	
1. Modèle de régression linéaire	

2. Moindres carrés ordinaires	
3. Inférence et tests d'hypothèses	
4. Analyse asymptotique	
4a. Bootstrap	
5. Erreurs de spécification, collinéarité, variables binaires et tests de Chow	
7. Hétéroscédasticité et autocorrélation	
6. Variables instrumentales	
8. Maximum de vraisemblance	
9. Modèles de choix discrets	
10. Modèles à variable dépendante limitée	
11. Données en panel	
Exercices et examens pratiques	
Travaux pratiques	

Note : Veuillez vous référer à la section *Contenu et activités* de votre site de cours pour de plus amples détails.

Évaluations et résultats

Liste des évaluations

Sommatives			
Titre	Date	Mode de travail	Pondération
Intra	Le 24 oct. 2024 de 12h30 à 15h20	Individuel	30 %
Examen final (cumulatif sur toute la session)	Le 19 déc. 2024 de 12h30 à 15h20	Individuel	50 %
Travail pratique 1	Dû le 18 oct. 2024 à 17h00	En équipe	10 %
Travail pratique 2	Dû le 6 déc. 2024 à 17h00	En équipe	10 %

Formatives		
Titre	Date	Mode de travail
Cette liste ne contient aucun élément.		

Informations détaillées sur les évaluations sommatives

Intra

Date :	Le 24 oct. 2024 de 12h30 à 15h20
Mode de travail :	Individuel
Pondération :	30 %
Remise de l'évaluation :	à déterminer

Notez que la forme de l'examen peut être changée selon l'évolution de la pandémie.

Matériel autorisé : Aucun matériel n'est autorisé

Examen final (cumulatif sur toute la session)

Date : Le 19 déc. 2024 de 12h30 à 15h20

Mode de travail : Individuel

Pondération : 50 %

Remise de l'évaluation : À déterminer

Notez que la forme de l'examen peut être changée selon l'évolution de la pandémie.

Matériel autorisé : Aucun matériel n'est autorisé.

Travail pratique 1

Date de remise : 18 oct. 2024 à 17h00

Les équipes qui remettront leur devoir après 17 heures verront leur note réduite de 10 pourcent. Cette pénalité sera appliquée pour chaque 24 heures de retard.

Mode de travail : En équipe

Pondération : 10 %

Remise de l'évaluation : [Boîte de dépôt](#)

Travail pratique 2

Date de remise : 6 déc. 2024 à 17h00

Les équipes qui remettront leur devoir après 17 heures verront leur note réduite de 10 pourcent. Cette pénalité sera appliquée pour chaque 24 heures de retard.

Mode de travail : En équipe

Pondération : 10 %

Remise de l'évaluation : [Boîte de dépôt](#)

Barème de conversion

Cote	% minimum	% maximum
A+	90	100
A	85	89,99
A-	80	84,99
B+	75	79,99
B	70	74,99
B-	65	69,99

Cote	% minimum	% maximum
C+	60	64,99
C	50	59,99
E	0	49,99

Règlements et politiques institutionnels

Règlement disciplinaire

Infractions relatives au bon ordre

Tout étudiant a une obligation de bon comportement dans un lieu universitaire ou à l'occasion d'une activité universitaire.

Infractions relatives aux études

Dans le but de préserver la crédibilité des attestations ou des diplômes délivrés et afin de s'assurer que les relevés de notes et les diplômes témoignent de la compétence et de la formation réelle des étudiants, il est interdit d'avoir des comportements répréhensibles associés au plagiat.

Pour en connaître davantage sur le plagiat et ses formes, vous pouvez consulter le site du [Bureau des droits étudiants](#), la capsule d'information [Citer ses sources et éviter le plagiat](#) et le site de la [Bibliothèque](#) pour savoir comment citer vos sources.

Tout étudiant qui commet une infraction au *Règlement disciplinaire à l'intention des étudiants de l'Université Laval* dans le cadre du présent cours, est passible des sanctions qui sont prévues dans ce règlement.

Consultez le règlement à l'adresse suivante : <http://ulaval.ca/reglement-disciplinaire>

Harcèlement et violence à caractère sexuel

La Faculté des sciences sociales condamne toute manifestation de harcèlement psychologique, de harcèlement sexuel et de toute autre forme de violence à caractère sexuel. Dans le cadre des activités universitaires sous sa responsabilité, elle s'engage à prendre tous les moyens à sa disposition pour prévenir les conduites (comportements, paroles, actes ou gestes) qui portent atteinte à la dignité ou à l'intégrité psychologique ou physique, les faire cesser et sanctionner.

Consultez le règlement à l'adresse suivante : <http://ulaval.ca/reglement-prevention-harcelement>

Visitez le site du Centre de prévention et d'intervention en matière de harcèlement : <https://www2.ulaval.ca/services-ul/harcelement.html>


Politique et directives relatives à l'utilisation de l'œuvre d'autrui aux fins des activités d'enseignement, d'apprentissage, de recherche et d'étude privée à l'Université Laval

L'Université s'est dotée d'une politique institutionnelle sur le droit d'auteur le 1er juin 2014. Les enseignants doivent effectuer par eux-mêmes une saine gestion de l'utilisation de l'œuvre d'autrui, et ce, en conformité avec la *Loi sur le droit d'auteur*.

La Politique a pour objet d'énoncer l'importance que l'Université accorde à la protection des droits des auteurs, d'établir les choix prioritaires qui doivent être faits par le Personnel enseignant relativement à l'utilisation de l'Œuvre d'autrui aux fins des activités d'enseignement, d'apprentissage, de recherche et d'étude privée et de définir un concept administratif de l'utilisation équitable de l'Œuvre d'autrui à ces fins.

Consultez la politique à l'adresse suivante : http://www.bibl.ulaval.ca/fichiers_site/bda/politique-oeuvre-autrui-ca-2014-85.pdf


Politique à l'égard des retards aux évaluations


Les étudiants sont invités à prendre connaissance de la [Politique du Département à l'égard des retards aux évaluations](#) . Suivant les règles de cette politique, l'étudiant qui se présente en retard à un examen pourrait ne pas être admis.

Politique en matière d'absence aux évaluations

Les étudiants sont invités à prendre connaissance de la [Politique du Département d'économique à l'égard des absences aux évaluations](#) . Une absence non justifiée suivant les règles de cette politique entraînera une note de zéro à l'évaluation manquée.

Étudiants ayant une situation de handicap liée à une limitation fonctionnelle

Afin de bénéficier de mesures d'accommodement pour les cours ou les examens, un rendez-vous avec une conseillère ou un conseiller du Centre d'aide aux étudiants travaillant en **accueil et soutien spécialisé en situation de handicap (ACSESH)** est nécessaire. Pour ce faire, les étudiants présentant une situation de handicap liée à une limitation fonctionnelle permanente doivent visiter le site monPortail.ulaval.ca/accommodement  et prendre un rendez-vous, le plus tôt possible.

Au cours de la semaine qui suit l'autorisation des mesures, l'activation des mesures doit être effectuée dans monPortail.ulaval.ca/accommodement  pour assurer leur mise en place.

Les étudiants ayant déjà obtenu des mesures d'accommodements scolaires doivent procéder à l'activation de leurs mesures pour les cours et/ou les examens dans monPortail.ulaval.ca/accommodement afin que celles-ci puissent être mises en place. Notez que l'activation doit s'effectuer au cours des 2 premières semaines de cours.

Matériel didactique

Liste du matériel obligatoire

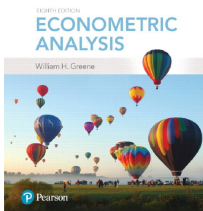


Économétrie

Auteur : William H. Greene, Wladimir Raymond, Phu Nguyen Van, Théophile Azomahou, Didier Schlachter

Éditeur : Pearson education France (Paris , 2011)

ISBN : 2744075280



Econometric analysis

Auteur : William H. Greene (2018)

ISBN : 9780134461366

Liste du matériel complémentaire



Microeconometrics : methods and applications

Auteur : Adrian Colin Cameron, P. K. Trivedi

Éditeur : Cambridge University Press (New York, NY , 2005)

ISBN : 0521848059



Econometric theory and methods

Auteur : Russell Davidson, James G. MacKinnon

Éditeur : Oxford University Press (New York , 2004)

ISBN : 0195123727

Bibliographie et annexes

Bibliographie

Cette sous-section n'a pas encore été complétée par votre enseignant.