Faculté des sciences sociales
Département d'économique

UNIVERSITÉ LAVAL

PLAN DE COURS

ECN-7220 : Macroéconométrie

NRC 14399 | Hiver 2023

Mode d'enseignement : Présentiel	
Temps consacré : 3-0-6	**Crédit(s) :** 3

Introduction théorique et pratique à l'économétrie des séries chronologiques. Rappels d'algèbre linéaire et de probabilités; modèles linéaires univariés et multivariés; analyse spectrale; filtre de Kalman; hétéroscédasticité conditionnelle et modèles en temps continu. Méthodes bayesiennes et chaînes markoviennes abordées si le temps le permet. Applications en économie et en finance.

Veuillez prendre note que, sous réserve des consignes de la Direction de la santé publique, de la capacité des salles et de l'attribution des locaux, l'accès à l'enseignement en présentiel pourrait être limité.

Plage horaire

Cours en classe			
mercredi	09h00 à 11h50	DES-2128	Du 10 janv. 2023 au 21 avr. 2023

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=149344

Coordonnées et disponibilités

Nikolaos Charalampidis
Professeur Adjoint
DES 2264
nikolaos.charalampidis@ecn.ulaval.ca

Disponibilités
Voir les instructions du premier courriel.

© Université Laval

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

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 permettrez 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

Introduction 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

Travail Pratique 1 5

Travail Pratique 2/Examen Intra 5

Travail Pratique 3 5

Travail Pratique 4 / Examen Final 5

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 7

Liste du matériel obligatoire 7

Spécifications technologiques 7

Bibliographie et annexes 8

Bibliographie 8

© Université Laval

Description du cours

Introduction

L'analyse des séries chronologiques est devenue une part fondamentale de la macroéconomie conjoncturelle et de l' économie financière. Ce cours constitue un traitement avancé des théories, modèles, et méthodes d'estimation nécessaires à l'analyse des données chronologiques. Ce cours débute avec une introduction et avance progressivement sur des sujets plus avancés. Des applications sur les politiques macro-économiques, l'économie internationale, et finance sont étudiées.

Objectifs généraux

Analyse avancée des séries chronologiques. Les étudiants apprendront à utiliser et estimer eux-mêmes des modèles afin de répondre à des questions économiques.

Objectifs spécifiques

Au terme de ce cours, l'attention sera portée à la mise en application des techniques présentées à l'aide du logiciel R (ou matlab). L'étudiant sera capable d'effectuer et maîtriser des estimations, et d'évaluer leurs qualitées.

Contenu du cours

Partie I: modèles vectoriels

Partie II: modèles d'espace d'état

Partie III: sujets avancés

Note: Veuillez consulter le *plan de cours en format pdf* à la section *Contenu et activités* de votre site de cours pour de plus amples détails.

Note: Veuillez noter que le matériel du cours restera disponible en principe 1 mois après la fin du cours.

Approche pédagogique

Un cours magistral chaque semaine.

Contenu et activités

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

Titre	Date
plan de cours en format pdf	
Partie I. Modèles Vectoriels	
Partie II. Modèles d'Espace d'État	
Partie III. Sujets Avancés	
TP 1	
TP 2 / Examen Intra	

TP 3	
TP 4 / Examen Final	

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
Travail Pratique 1	À déterminer	En équipe	20 %
Travail Pratique 2/Examen Intra	À déterminer	En équipe	30 %
Travail Pratique 3	À déterminer	En équipe	20 %
Travail Pratique 4 / Examen Final	À déterminer	En équipe	30 %

Informations détaillées sur les évaluations sommatives

Travail Pratique 1

Date de remise : À déterminer
Mode de travail : En équipe
Pondération : 20 %
Remise de l'évaluation : nikolaos.charalampidis@ecn.ulaval.ca

Travail Pratique 2/Examen Intra

Date de remise : À déterminer
Mode de travail : En équipe
Pondération : 30 %
Remise de l'évaluation : nikolaos.charalampidis@ecn.ulaval.ca

Travail Pratique 3

Date de remise : À déterminer
Mode de travail : En équipe
Pondération : 20 %
Remise de l'évaluation : nikolaos.charalampidis@ecn.ulaval.ca

Travail Pratique 4 / Examen Final

Date de remise : À déterminer
Mode de travail : En équipe

© Université Laval

Pondération : 30 %

Remise de l'évaluation : nikolaos.charalampidis@ecn.ulaval.ca

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 connaitre 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 entrainera 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

Voir le plan de cours en format pdf dans le contenu et activités.

Spécifications technologiques

Afin d'accéder sans difficulté au contenu de votre cours sur monPortail, vous devez vous référer aux informations ci-dessous.

Liste des navigateurs supportés :

- Google Chrome
- Mozilla Firefox
- Safari
- Internet Explorer 11 et plus
- Opera

Appareils mobiles

Il est important de préciser que l'utilisation des périphériques mobiles n'est pas officiellement supportée pour les sites de cours. La consultation des contenus est fonctionnelle pour la plupart des appareils sous Android et iOS, mais il existe certaines limites :

- les appareils mobiles sous Windows RT, BlackBerry et les iPhone 4 et 4S ne sont pas supportés;
- le contenu Flash n'est pas supporté, ce qui empêche la consultation des blocs de contenu audio-vidéo, de contenu Flash et de certaines présentations multimédias;
- la fonctionnalité de glisser-déposer n'est pas supportée, ce qui empêche la réalisation de certains questionnaires.

Team Viewer

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

- Accédez à TeamViewer pour Windows
- Accédez à TeamViewer pour Mac

Bibliographie et annexes

Bibliographie

Voir le plan de cours en format pdf dans le contenu et activités.