

**ECN-11517 - Économétrie / ECN-64703 Économétrie I**

*Objectifs du cours*

Ce cours est un survol de la méthodologie et des techniques techniques'conométriques statistiques et de la théorie de la probabilité pour des étudiants de maîtrise ainsi que des étudiants du premier cycle qui se préparent pour des études supérieures.

*Heures de bureau*

Ceux et celles qui aimeraient me rejoindre en dehors des heures de classes peuvent le faire durant les heures de bureau, le jeudi de 9h à 11h, ou prendre rendez-vous.

*Évaluation*

Travaux pratiques: 20 %

Examen mi-session 40 %

Examen final 40 %

**Lectures**

**Manuel obligatoire**

Greene, William H. *Économétrie*, 5e édition. Pearson:2005

## Plan de cours:

- 14 janvier: Moindres carrées ordinaires I  
Greene, chs 1, 2, 3
- 21 janvier: Moindres carrées ordinaires II  
Greene, ch 4
- 28 janvier: Théorie asymptotique  
Greene, annexe D, ch 5.1-5.3
- 4 février: Inférence et prédiction  
Greene, chs 6, 7, 8, annexe C.4-C.7
- 11 février: Hétéroscédasticité et le modèle de régression généralisée  
Greene, chs 10, 11
- 18 février: Méthode des moments et variables instrumentales  
Greene, chs 5.4-5.6, 18
- 25 février: Maximum de vraisemblance  
Greene, ch 17
- 4 mars: Semaine de lecture
- 11 mars: Examen intra
- 18 mars: Méthodes bayésiennes  
Notes distribuées
- 25 mars: Échantillonnage de Gibbs  
Notes distribuées
- 1 avril: Équations simultanées et l'identification  
Greene, ch 15

8 avril: Modèles de séries chronologiques

Greene, ch 20

15 avril: Modèles de choix discret

Greene, chs 21

22 avril: Variables dépendantes limitées

Greene, chs 22

29 avril: Examen final