

**ECN-4100 - Économétrie / ECN-6020 Économétrie I**

*Objectifs du cours*

Ce cours est un survol de la méthodologie et des techniques économétriques 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. Vous pouvez me joindre à

`stephen@ecn.ulaval.ca`

*Évaluation*

Travaux pratiques: 20 %

Examen mi-session 40 %

Examen final 40 %

**Lectures**

**Manuel obligatoire**

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

**Notes de cours**

[http://www.ecn.ulaval.ca/~sgor/cours/ecn4100\\_6020](http://www.ecn.ulaval.ca/~sgor/cours/ecn4100_6020)

## Plan de cours:

13 janvier: Moindres carrées ordinaires I

Greene, chs 1, 2, 3

20 janvier: Moindres carrées ordinaires II

Greene, ch 4

27 janvier: Théorie asymptotique

Greene, annexe D, ch 5.1-5.3

3 février: Inférence et prédiction

Greene, chs 6, 7, 8, annexe C.4-C.7

10 février: Hétéroscédasticité et le modèle de régression généralisée

Greene, chs 10, 11

17 février: Méthode des moments et variables instrumentales

Greene, chs 5.4-5.6, 18

24 février: Maximum de vraisemblance

Greene, ch 17

3 mars: Semaine de lecture

10 mars: Examen intra

17 mars: Méthodes bayésiennes

Notes distribuées

24 mars: Échantillonnage de Gibbs

Notes distribuées

31 mars: Équations simultanées et l'identification

Greene, ch 15

7 avril: Modèles de séries chronologiques

Greene, ch 20

14 avril: Modèles de choix discret

Greene, chs 21

21 avril: Variables dépendantes limitées

Greene, chs 22

28 avril: Examen final

### Barèmes de notation

ECN-4100		ECN-6020	
90-100	A+	90-100	A+
85-90	A	85-90	A
80-84	A-	80-84	A-
75-79	B+	75-79	B+
70-74	B	70-74	B
66-69	B-	65-69	B-
63-65	C+	60-64	C+
60-62	C	50-59	C
56-59	C-		
53-55	D+		
50-52	D		
0-50	E	0-50	E

## Règles disciplinaires

Tout étudiant qui commet une infraction au Règlement disciplinaire à l'intention des étudiants de l'Université Laval dans le cadre du présent cours, notamment en matière de plagiat, est passible des sanctions qui sont prévues dans ce règlement. Il est très important pour tout étudiant de prendre connaissance des articles 28 à 32 du Règlement disciplinaire. Celui-ci peut être consulté à l'adresse suivante:

[http://www.ulaval.ca/sg/reg/Reglements/Reglement\\_disciplinaire.pdf](http://www.ulaval.ca/sg/reg/Reglements/Reglement_disciplinaire.pdf)

## Plagiat

Tout étudiant est tenu de respecter les règles relatives à la protection du droit d'auteur. Constitue notamment du plagiat le fait de:

- (i) copier textuellement un ou plusieurs passages provenant d'un ouvrage sous format papier ou électronique sans mettre ces passages entre guillemets et sans en mentionner la source;
- (ii) résumer l'idée originale d'un auteur en l'exprimant dans ses propres mots (paraphraser) sans en mentionner la source;
- (iii) traduire partiellement ou totalement un texte sans en mentionner la provenance;
- (iv) remettre un travail copié d'un autre étudiant (avec ou sans l'accord de cet autre étudiant);
- (v) remettre un travail téléchargé d'un site d'achat ou d'échange de travaux scolaires.

(Source: COMMISSION DE L'ÉTHIQUE DE LA SCIENCE ET DE LA TECHNOLOGIE, *La tricherie dans les évaluations et les travaux à l'université: l'éthique à la rescousse* (rédaction: Denis Boucher), Québec, 15 mai 2009)