Maîtrise en économique

Téléphone : 514 987-8362
Courriel : prog.sup.economie@uqam.ca
Site Web : esg.uqam.ca/programmes/maitrise-en-economique/

Code	Titre	Grade	Crédits
3424	Programme général	Maître ès sciences, M.Sc.	45
3524	Concentration en économie financière	Maître ès sciences, M.Sc.	45

Trimestre(s) d'admission	Automne Hiver
Contingent	Programme non contingenté
Régime et durée des études	Temps complet : 2 ans Temps partiel : 4 ans
Campus	Campus de Montréal
Organisation des études	Cours offerts le soir Cours offerts le jour

OBJECTIFS

Ce programme de maîtrise en économique vise à donner une formation de recherche orientée principalement sur les questions de politiques économiques. Le programme met ainsi l'accent autant sur la connaissance des théories économiques existantes et des débats contemporains que sur l'application concrète de ces connaissances à certains domaines particuliers. Bien que le programme général de maîtrise ne prévoie aucune concentration formelle l'étudiant peut, selon le choix de cours, privilégier les champs d'intérêt suivants: économie publique, travail et répartition, stabilisation et croissance, développement et économie internationale, histoire de la pensée économique.

CONDITIONS D'ADMISSION

Le candidat doit être titulaire d'un baccalauréat ou l'équivalent en économique ou titulaire d'un grade de bachelier par cumul de programmes incluant au moins un certificat en économique (ou l'équivalent) obtenu avec une moyenne cumulative d'au moins 3,2 sur 4,3 ou l'équivalent. Tout dossier de candidature avec une moyenne inférieure à 3,2 mais supérieure à 2,8 sur 4,3 sera étudié par le sous-comité d'admission et d'évaluation du programme et pourrait, dans certains cas, faire l'objet d'une recommandation d'admission;
ou
posséder les connaissances requises, une formation appropriée et une expérience jugée pertinente.

Le SCAE du programme déterminera si les cours en économique suivis antérieurement par le candidat répondent aux attentes du programme. Dans le cas contraire, le candidat admis se verra imposer de suivre et réussir une formation d'appoint avant la première inscription à la maîtrise.

Capacité d'accueil
Le programme n'est pas contingenté.

Trimestre d'admission (information complémentaire)
Admission aux trimestres d'automne et d'hiver.

Admissions conditionnelles
Remarque : Lorsqu'il reste à un candidat au plus six crédits pour obtenir son baccalauréat, celui-ci ne sera admis conditionnellement que s'il a réussi, avant la première inscription à la maîtrise, les cours obligatoires d'économique du baccalauréat en économique:
ECO1013 Microéconomie I
ECO1023 Macroéconomie I
ECO1273 Méthodes d'analyse économique I
ECO2013 Microéconomie II
ECO2023 Macroéconomie II
ECO2273 Économétrie I
ECO3013 Microéconomie III
ECO3023 Macroéconomie III
ECO3273 Méthodes d'analyse économique II
ECO4273 Économétrie II
* Remarque pour les titulaires de la majeure en mathématiques (6486) : les contenus des cours ECO1273, ECO2273, ECO3273 et ECO4273 sont couverts dans les cours en mathématiques de la majeure en mathématiques.

Méthode et critères de sélection
Évaluation du dossier académique et des lettres de recommandation.

Régime et durée des études
Temps complet : deux ans
Temps partiel : quatre ans

COURS À SUIVRE

(Sauf indication contraire, les cours comportent 3 crédits. Certains cours ont des préalables. Consultez la description des cours pour les connaître.)

PROGRAMME GÉNÉRAL (code 3424)

Les quatre cours suivants (12 crédits) :
ECO7001 Microéconomie avancée
ECO7011 Macroéconomie avancée
ECO7020 Séminaire de recherche
ECO7036 Économétrie I

Note : L'étudiant qui aura réussi le cours ECO5272 Économétrie ou l'équivalent avec la note A ou B pourra substituer un cours à option au cours ECO7036 Économétrie 1.

Trois cours au choix parmi les suivants (9 crédits) :
ECO8000 Économie du travail
ECO8005 Économie publique
ECO8021 Finances internationales
ECO8025 Économie du développement
ECO8035 Histoire de la pensée économique
ECO8051 Commerce international
ECO8056 Économie industrielle
ECO8061 Cycle et politiques économiques
ECO8066 Économie financière
ECO8070 Cours de lectures dirigées
ECO8071 Économie des ressources naturelles et de l'environnement
ECO8086 Applications de modèles économiques
ECO8530 Investissement et risque
ECO8620 Économétrie de la finance et applications
ECO9001 Microéconomie avancée II
ECO9011 Macroéconomie avancée II
ECO9015 Méthodes d'analyse dynamique
ECO9035 Microéconométrie
ECO9036 Macroéconométrie
ou tout autre cours autorisé par la direction du programme.

Mémoire (24 crédits)

L'étudiant doit rédiger un mémoire qui témoigne de ses aptitudes particulières à la recherche.

CONCENTRATION EN ÉCONOMIE FINANCIÈRE (3524)

Les cinq cours suivants (15 crédits) :
ECO7001 Microéconomie avancée
ECO7011 Macroéconomie avancée
ECO7020 Séminaire de recherche
ECO7036 Économétrie I
ECO8066 Économie financière
Deux cours au choix parmi les suivants (6 crédits) :
ECO8021 Finances internationales
ECO8086 Applications de modèles économiques
ECO8530 Investissement et risque
ECO8620 Économétrie de la finance et applications
ECO9035 Microéconométrie
ou
ECO9036 Macroéconométrie
ou tout autre cours d'un programme d'études de cycles supérieurs, relié à l'économie financière et autorisé par la direction du programme.

Mémoire (24 crédits) :

L'étudiant doit rédiger un mémoire dont le sujet est en économie financière.

Remarque : Le candidat voudra bien prendre note que les activités au choix dans ce programme et énumérées ci-dessus ne peuvent être offertes à chacun des trimestres (automne, hiver ou été). Par conséquent, elles sont réparties sur plusieurs trimestres et sont donc offertes en alternance d'un trimestre, voire d'une année à l'autre.

CHAMPS DE RECHERCHE

Analyse économique du droit

Économétrie

Économie des ressources humaines

Économie des ressources naturelles et de l'environnement

Économie du développement

Économie financière

Économie internationale

Économie publique

Histoire et philosophie de la pensée économique

Macroéconomie

Microéconomie

FRAIS

Pour les fins d'inscription et de paiement des frais de scolarité, ce programme est rangé dans la classe B.

DESCRIPTION DES COURS

ECO7001 Microéconomie avancée
Étude explicative et normative de la production, de la distribution, de la consommation et des institutions qui s'y rattachent. Théories de la valeur. Structures de marche. Décisions publiques et décentralisation. La prise en compte du temps et de l'incertain. Concepts d'équilibre et de déséquilibre.

ECO7011 Macroéconomie avancée
Étude approfondie des théories et politiques macroéconomiques en économie fermée et ouverte. Aspects statiques et dynamiques de la détermination de la production réelle et des prix. État des débats sur la gestion macroéconomique. Contrainte de financement des gouvernements. Inflation et chômage.

ECO7020 Séminaire de recherche
Ce cours a pour but d'initier l'étudiant à l'ensemble des activités de recherche, aux principales étapes que comporte normalement toute recherche scientifique ainsi qu'au processus du choix d'une méthodologie. Il vise également à guider l'étudiant dans la définition de son projet de mémoire qu'il devra présenter dans le cadre du séminaire.

ECO7036 Économétrie I
Revue du modèle linéaire général de régression; méthodes des moindres carrés généralistes et du maximum de vraisemblance; conséquences, diagnostic et correction de problèmes tels la multicolinéarité, les erreurs de spécification, l'autocorrélation des résidus, les régresseurs stochastiques et les erreurs dans les variables; modèles à retards échelonnés et modèles autorégressifs. Identification et estimation des modèles à équations simultanées; méthodes d'estimation à information limitée et à information complète. Évaluation de modèles économétriques appliqués.

ECO8000 Économie du travail
Étude de l'économie du marché du travail, tant dans ses aspects théoriques, empiriques que de politiques économiques. Analyse de la participation et de l'offre de travail: impact de la fiscalité et des programmes de transfert, aspects intertemporels de l'allocation du temps, évolution cyclique. Analyse dynamique des comportements sur le marché du travail. Analyses non walrasiennes du marché du travail: comportements en présence de rationnement quantitatif, modèles hédonistes et modèles de contrats. Théorie de l'investissement en capital humain et politiques de formation de la main-d'oeuvre. Impact des changements technologiques. Analyse économique de la discrimination salariale et occupationnelle.

ECO8005 Économie publique
Théories, définitions et rôle de l'État. Analyse économique des biens publics, des externalités et des droits de propriété. Sécurité du revenu et assurances sociales. Étude systématique des choix collectifs et des critères de justice économique. Efficacité, réglementation, bureaucratie et secteur public. Choix sociaux stratégiques. Analyse économique de

l'équité, de l'efficacité et des incitations des prélèvements fiscaux. Théorie de la taxation. Modèles et aspects de l'incidence fiscale. Aspects théoriques et empiriques de la fiscalité des personnes, des sociétés, des biens et du patrimoine.

ECO8021 Finances internationales
Analyse théorique et empirique des finances internationales. Déterminants et dynamique de la balance des paiements et des taux de change; efficience du marché des changes; attaques spéculatives et crises de la balance des paiements; intervention optimale sur le marché des actifs; transmission internationale de l'inflation et des cycles économiques; coordination internationale des politiques de stabilisation; système monétaire international.

ECO8025 Économie du développement
Mesure et concepts du sous-développement. Étude des principales théories du développement et du sous-développement. Rôle des transferts technologiques, de la démographie et de la politique commerciale dans le développement économique. Impact de la libéralisation des marchés financiers. Problème de l'endettement. Études de cas.

ECO8035 Histoire de la pensée économique
Étude approfondie de certaines oeuvres marquantes dans l'histoire de la pensée économique, représentatives de divers courants qui s'y sont manifestés: mercantilisme, physiocratie, économie politique classique, théories marxiste, néo-classique, keynésienne et néo-ricardienne.

ECO8051 Commerce international
Étude approfondie des théories du commerce international, des théories de la politique commerciale et de leurs applications. Libéralisation bilatérale et multilatérale des échanges ; théorie des choix commerciaux stratégiques. Zone de libre-échange, union douanière et marché commun. Évaluation de la politique commerciale canadienne.

ECO8056 Économie industrielle
Théories du comportement de la firme en situation de concurrence et d'information imparfaites et leurs applications. Structures de marché, politiques d'établissement des prix, choix et différenciation des produits, intégration verticale et horizontale, productivité, recherche et développement et adoption de nouvelles technologies. Réglementation et politique de concurrence. Études empiriques.

ECO8061 Cycle et politiques économiques
Étude des développements récents en macroéconomie. Approches d'équilibre général à la théorie du cycle économique; approche par les contrats de prix et de salaire; sources et propagation dynamique des fluctuations économiques; formation des attentes. Étude empirique de l'évolution dynamique de la production, du chômage et de l'inflation dans les pays industriels.

Préalables académiques
ECO7011 Macroéconomie avancée ou ECO9011 Macroéconomie avancée II

ECO8066 Économie financière
Équilibre des marchés financiers domestiques et internationaux; structures des taux d'intérêt. Évaluation des actifs financiers: modèle d'équilibre des actifs financiers, modèle d'évaluation par arbitrage, modèle d'évaluation des actifs fondé sur la consommation. Diversification du portefeuille. Marché des options; marché à terme; efficience des marchés; bulles spéculatives. Théorème de la séparation. Impacts de la fiscalité.

ECO8070 Cours de lectures dirigées
Permettre d'approfondir certains aspects particuliers des champs d'intérêt prévus au programme. L'étudiant devra faire la preuve que le sujet proposé n'est pas couvert dans l'un ou l'autre des cours du programme.

ECO8071 Économie des ressources naturelles et de l'environnement
Application de la théorie du capital et des méthodes d'analyse dynamiques à l'économie des ressources naturelles et de l'environnement. Critères de gestion optimale dans le cas des ressources renouvelables, épuisables ou non, et des ressources non renouvelables. Analyses de cas, en fonction de l'intérêt des participants: pêches et forêts, mines, pollution, conservation de l'eau, etc. Étude de thèmes particuliers: taxation des activités polluantes, ressources naturelles et développement durable, évaluation des rentes de ressources et applications à la comptabilité nationale «verte». commerce et développement des économies à forte intensité en ressources, etc.

ECO8086 Applications de modèles économiques
Ce cours vise à donner une formation concrète dans l'application de certaines techniques d'analyse économique et implique l'utilisation de logiciels informatiques. Les applications peuvent concerner la simulation, la prévision et l'analyse de politiques à partir de modèles d'équilibre général, de modèles intersectoriels et de modèles économétriques.

ECO8530 Investissement et risque
Analyse des projets d'investissement et autres décisions irréversibles en contexte incertain. Le cours insiste sur l'importance du choix des dates des décisions irréversibles. On recourt notamment à la méthode des options réelles pour déterminer les prix critiques et évaluer l'option d'investir. L'étudiant se familiarise avec les méthodologies issues de la finance (méthode des actifs contingents par exemple) ou celles qui s'appliquent lorsque les conditions de validité du CAPM ne sont pas réunies (Programmation dynamique). On expérimente avec l'utilisation pratique des méthodologies présentées, programmation dynamique, approximation numérique des équations de Black et Scholes, approximations binomiales des processus stochastiques en temps continu par exemple. On illustre également l'application des techniques présentées dans des contextes aussi variés que les décisions de lutte contre le changement climatique ou les décisions de R et D.

ECO8620 Économétrie de la finance et applications
Ce cours vise à intégrer, approfondir et appliquer certains thèmes abordés dans les cours ECO8600 Fondements économétriques de la finance et MAT8510 Calcul stochastique appliqué. Maximum de vraisemblance Modèles linéaires multivariés Modèles à facteurs Modèles ARCH-GARCH multivariés Méthode des moments généralisés Méthodes simulées d'estimation Réseaux de neurones Méthodes non paramétriques Techniques quantitatives appliquées aux microstructures de marché

Modalité d'enseignement
Cours avec séances de laboratoire.

Préalables académiques
ECO8600 Fondements économétriques de la finance ou MAT8181 Séries chronologiques ET MAT8511 Calcul stochastique appliqué ou MAT8601 Méthodes stochastiques en finance I

ECO9001 Microéconomie avancée II
Étude approfondie de certains aspects de la théorie microéconomique particulièrement utiles pour la formation d'un bon chercheur en microéconomie et dans les domaines connexes. Analyse microéconomique des problèmes associés à l'incertain et à l'information. Comportements dans l'incertain. Mesures du risque et de l'aversion pour le risque. Structure d'information, valeur de l'information et effets d'irréversibilité. Allocation des ressources et équilibre général dans l'incertain: la théorie des marchés contingents et les systèmes incomplets de marchés. Asymétries d'information en équilibre partiel: modèles de prospection sur les prix et les qualités; transmission d'information par les prix. Asymétries d'information et échange: antisélection, risque moral et signaling. Applications diverses: marchés de l'assurance, du travail, du crédit, etc.

ECO9011 Macroéconomie avancée II
Étude approfondie de la théorie macroéconomique moderne avec une

emphase sur les modèles formels de l'analyse macroéconomique dynamique. Les thèmes abordés concernent entre autres les modèles d'équilibre du cycle économique, les modèles avec rigidités nominales, les modèles macroéconomiques d'économie ouverte, les politiques fiscales et monétaires et les microfondements de la macroéconomie.

ECO9015 Méthodes d'analyse dynamique
Ce cours vise à familiariser l'étudiant avec les méthodes mathématiques appliquées à l'analyse économique et en particulier avec les méthodes d'optimisation dynamique. Les sujets couverts comprennent la solution et la stabilité de systèmes d'équations différentielles (déterministes et stochastiques), la théorie de la commande optimale et la programmation dynamique.

ECO9035 Microéconométrie
Ce cours traite des techniques économétriques utilisées dans la recherche sur le comportement de petites unités économiques (individus, ménages et firmes). La première partie du cours est consacrée à la théorie des grands nombres et aux propriétés asymptotiques des estimateurs fondés sur le principe d'optimisation. Le reste du cours vise à étudier les modèles économiques et les techniques d'estimation correspondantes: par exemple, les modèles avec terme d'erreur composé (effets fixes et effets aléatoires); les modèles non linéaires (une ou plusieurs équations) et les tests d'hypothèses qui leur sont particuliers; les modèles avec variable dépendante qualitative ou censurée; les modèles de durée. Dans chaque cas, nous examinerons la possibilité d'estimer les modèles avec des techniques semi ou non paramétriques.

ECO9036 Macroéconométrie
Ce cours avancé traite de problèmes et de techniques spécifiques d'estimation et d'inférence en macroéconométrie: par exemple, tests de spécification des modèles, méthodes univariées et multivariées des séries chronologiques stationnaires, tests de non-stationarité et de cointégration, modèles d'ajustement dynamiques, méthodes des moments généralisés, et des moments simulés, techniques de simulation numérique. Les illustrations et applications sont choisies parmi les questions à la frontière des débats actuels en macroéconomie réelle, monétaire et financière.

N.B. : Le masculin désigne à la fois les hommes et les femmes sans aucune discrimination et dans le seul but d'alléger le texte.
Cet imprimé est publié par le Registrariat. Basé sur les renseignements disponibles le 24/04/14, son contenu est sujet à changement sans préavis.
Version Hiver 2013