

## Doctorat en économie

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

| Code | Titre                | Grade                      | Crédits |
|------|----------------------|----------------------------|---------|
| 3747 | Doctorat en économie | Philosophiae Doctor, Ph.D. | 90      |

|                                   |                                                |
|-----------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>Trimestre(s) d'admission</b>   | Automne                                        |
| <b>Contingent</b>                 | Programme non contingenté                      |
| <b>Régime et durée des études</b> | Temps complet : 4 ans<br>Temps partiel : 6 ans |
| <b>Campus</b>                     | Campus de Montréal                             |
| <b>Organisation des études</b>    | Cours offerts le soir<br>Cours offerts le jour |

### OBJECTIFS

Le programme de doctorat en économie a pour objectif de former des chercheurs de haut niveau en sciences économiques, plus particulièrement dans les domaines de spécialisation du programme. Les chercheurs seront à même de faire avancer les connaissances dans leur champ respectif, d'utiliser les techniques les plus sophistiquées pour résoudre les problèmes complexes qui leur seront posés, ainsi que de développer au besoin de nouveaux outils d'analyse et de gestion économique.

Les étudiants peuvent se spécialiser dans tout champ dans lequel des membres du corps professoral ont leur spécialité.

### CONDITIONS D'ADMISSION

Être titulaire d'une maîtrise en économie ou l'équivalent, obtenue avec une moyenne d'au moins 3,2 sur 4,3 ou l'équivalent.

Sont aussi admissibles les étudiants qui, sans détenir une maîtrise, auront complété avec succès la première année du programme de maîtrise en économie (c'est-à-dire les activités pédagogiques, à l'exclusion du mémoire) avec une moyenne d'au moins 3,5 sur 4,3 et qui, de l'avis du sous-comité d'admission et d'évaluation, auront démontré la capacité et la volonté de mener à terme des études de doctorat.

Une personne qui, dans le cadre de sa scolarité de maîtrise, réussit des activités prévues dans le programme de doctorat s'en verra exemptée. Par contre, si le sous-comité d'admission et d'évaluation juge qu'une personne n'a pas les connaissances requises et une formation appropriée, il peut lui imposer des cours d'appoint.

#### Capacité d'accueil

Le programme n'est pas contingenté. La capacité d'accueil est déterminée en fonction de la capacité d'encadrement du corps professoral.

#### Trimestre d'admission (information complémentaire)

Admission à l'automne seulement.

#### Méthode et critères de sélection

Évaluation :

- du dossier académique et des lettres de recommandation par le Sous-comité d'admission et d'évaluation;
- du projet de recherche, d'une longueur d'une page.

#### Régime et durée des études

En début de programme, l'étudiant doit s'inscrire à temps plein pendant au moins six trimestres.

Temps complet : quatre ans.

Temps partiel : six ans.

La résidence minimale est de deux ans à temps plein.

### COURS À SUIVRE

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

Ce programme d'études comporte 90 crédits dont 30 sont rattachés à la scolarité. Chacun des cours de la banque correspond à 3 crédits. La thèse compte pour 60 crédits.

#### Scolarité (30 crédits)

##### a) Compléments dans les disciplines fondamentales (12 crédits)

Ce cycle de formation vise à donner à l'étudiant une connaissance approfondie des outils méthodologiques fondamentaux de la science économique, en particulier en microéconomie et en macroéconomie. Il s'agit là d'un prérequis pour que les objectifs généraux de formation du programme puissent être atteints.

#### Quatre cours choisis comme suit :

##### Les trois cours suivants

ECO9001 Microéconomie avancée II  
ECO9011 Macroéconomie avancée II  
ECO9015 Méthodes d'analyse dynamique

## Un cours parmi les suivants

ECO9035 Microéconométrie

ECO9036 Macroéconométrie

Cette étape se termine par deux examens de synthèse, l'un en microéconomie et l'autre en macroéconomie, qui ont lieu normalement au début du semestre d'été de la première année.

Dans des cas particuliers, un étudiant pourrait avoir satisfait à ces exigences avant même d'avoir été admis au programme de doctorat, soit au terme d'une année de maîtrise.

## b) Spécialisation (15 crédits)

Ce cycle de formation vise à mener l'étudiant à la fine pointe des connaissances dans ses champs de spécialisation et à développer sa capacité d'appliquer les connaissances acquises pour résoudre des problèmes économiques concrets.

Cette phase du programme d'études comprend cinq cours de trois crédits chacun et deux examens de spécialisation dans les champs choisis par l'étudiant.

## Un cours choisi parmi les suivants :

ECO9200 Sujets en économie des ressources naturelles et de l'environnement

ECO9210 Sujets en économie financière

ECO9220 Sujets en économie publique

ECO9230 Sujets en macroéconomie

ECO9240 Sujets en histoire et philosophie de la pensée économique

ECO930X Sujets en théorie économique ou économétrie

## Quatre cours de spécialisation

Pour le choix des cours de spécialisation, l'étudiant a accès à la liste des cours des études de cycles supérieurs du Département des sciences économiques, à savoir :

ECO8000 Économie du travail

ECO8005 Économie publique

ECO8010 Analyse avantage-coût

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

ECO8620 Économétrie de la finance et applications

ECO8510 Économie du droit et de la réglementation

ECO8520 Microéconomie du risque et de la finance

ECO8530 Investissement et risque

ECO9035 Microéconométrie

ECO9036 Macroéconométrie

ECO9200 Sujets en économie des ressources naturelles et de l'environnement

ECO9210 Sujets en économie financière

ECO9220 Sujets en économie publique

ECO9230 Sujets en macroéconomie

ECO9240 Sujets en histoire et philosophie de la pensée économique

ECO930X Sujets en théorie économique ou économétrie

Pour les cours de spécialisation, l'étudiant a aussi accès à des cours relevant d'autres disciplines ou offerts dans d'autres programmes d'études supérieures en économie. Ce choix requiert l'approbation de la direction du programme. Les activités choisies doivent être pertinentes en regard du domaine d'étude de l'étudiant.

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.

## Examens de spécialisation

Les examens de spécialisation prennent la forme de travaux de recherche originaux sous la supervision de deux professeurs. Le premier examen de spécialisation a lieu pendant l'été de l'année d'inscription au programme. Le deuxième examen a lieu pendant l'été de la deuxième année. Tous deux font l'objet d'une présentation écrite et d'une présentation orale devant jury en fin d'été.

Ces deux travaux doivent démontrer l'habileté de l'étudiant à faire de la recherche dans les domaines choisis ainsi qu'une connaissance approfondie de ceux-ci.

L'évaluation sera littérale.

## c) Séminaire de recherche doctorale

Tout étudiant doit s'inscrire au cours :

ECO9100 Séminaire de recherche doctorale

## La thèse et sa soutenance (60 crédits)

La thèse doit s'inscrire dans les champs de spécialisation du programme. Elle doit apporter une contribution à l'avancement des connaissances dans le domaine. La thèse peut être de facture classique ou prendre la forme d'articles dont le contenu et la facture se prêtent aisément à une soumission rapide pour publication dans une revue spécialisée avec comité de lecture. La thèse est évaluée par un comité formé d'au moins quatre professeurs selon les règlements des études de deuxième et troisième cycles de l'UQAM et donne lieu à une soutenance publique.

## FRAIS

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

## DESCRIPTION DES COURS

### 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.

### **ECO9100 Séminaire de recherche doctorale**

Le séminaire vise à fournir un encadrement pédagogique soutenu des activités de recherche des étudiants en vue d'une réalisation rapide et efficace de la thèse. L'étudiant participe aux activités du séminaire à partir du moment où il réussit ses examens de synthèse de microéconomie et de macroéconomie jusqu'au dépôt final de la thèse. Le séminaire a pour objet l'élaboration, la présentation et l'étude en collectif des projets de thèse sous la supervision d'une équipe de professeurs-chercheurs. Dans les six mois qui suivent la réussite de son examen de spécialité, l'étudiant doit présenter son projet de thèse dans le cadre de ce séminaire. Par la suite, au moins une fois l'an, jusqu'au dépôt final, le candidat doit faire une présentation où il fait état de l'avancement de ses recherches. Cette activité est évaluée selon la notation succès-échec.

### **ECO9200 Sujets en économie des ressources naturelles et de l'environnement**

Cours à contenu variable abordant divers thèmes de recherche actuels en économie des ressources naturelles de l'environnement.

### **ECO9230 Sujets en macroéconomie**

Cours à contenu variable abordant divers thèmes de recherche actuels en théorie macroéconomique.

### **ECO9240 Sujets en histoire et philosophie de la pensée économique**

Cours à contenu variable abordant divers thèmes de recherche actuels en histoire et philosophie de la pensée économique

### **ECO930X Sujets en théorie économique ou économétrie**

Cours à contenu variable abordant divers thèmes de recherche actuels dans un domaine particulier de la théorie économique ou de l'économétrie.

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 06/05/13, son contenu est sujet à changement sans préavis.  
Version Hiver 2013