

UFR DE SCIENCES ÉCONOMIQUES ET DE GESTION

LICENCE SEG – 2025

Pour rappels :

Les objectifs du plan de réussite licence :

Cet enseignement s'inscrit pleinement dans le cadre du Plan Réussite Licence (PRL) visant à accompagner de manière plus personnalisée les étudiants tout au long de leur cursus, de développer leurs savoirs, savoir-faire et savoir-être à chaque niveau de formation, de les aider à formuler leur projet professionnel et à dessiner une trajectoire de formation pour le concrétiser.

L'objectif pédagogique général de la Licence dans le cadre du PRL : acquérir des connaissances, outils, méthodes et compétences permettant d'observer, de décrire et d'analyser les grands problèmes économiques et de gestion contemporains et d'évaluer les différentes solutions envisageables pour y faire face.

Les objectifs pédagogiques spécifiques par année dans le cadre du PRL :

L1 → Savoir décrire et comprendre les grands problèmes économiques et de gestion contemporains

L2 → Savoir identifier les principaux facteurs explicatifs de ces phénomènes notamment des modèles théoriques

L3 → Savoir évaluer les options, outils ou scénarios à mettre en place face à différents problèmes économiques ou de gestion

Intitulé du cours : ECONOMETRIE- INTRODUCTION

L 3 – S 6

Yves Croissant

y.croissant@univ-lyon2.fr

Eléments de l’Unité d’Enseignement :

- CM (nombre d’heures) : 24 (8 séances)
- TD (nombre d’heures) : 12 (6 séances)

Nombre de crédits ECTS validés par ce cours : 6 Crédits ECTS

Prérequis :

Le cours d'économétrie est un cours d'initiation. Il suppose néanmoins de maîtriser les principaux éléments de statistiques descriptives et inférentielles.

Objectifs pédagogiques :

Ce cours et les TD associés visent d'une part, à donner à chaque étudiant les principaux éléments de base de l'économétrie des variables quantitatives sur données en coupe transversale, une bonne compréhension de la démarche de la régression et d'autre part de découvrir et d'utiliser un outil permettant de manipuler des données pour réaliser ces calculs.

L'ensemble pédagogique est conçu pour permettre à l'étudiant de réaliser en autonomie totale (sur des cas simples) des analyses de régression simple et multiple dans le cadre d'un stage de fin d'année par exemple.

Compétences développées :

Maîtriser les fondements théoriques de la méthode des moindres carrés ordinaires
Maîtriser les bases du logiciel afin de réaliser différentes manipulations sur des tableaux de données et appliquer les méthodes d'estimation et de test vus en cours.

Plan de cours :

Modèle de régression linéaire simple

Espérance conditionnelle et covariance

Données et modèle structurel

Calcul des estimateurs

Interprétation géométrique

Résultats de l'estimation

Propriétés statistiques de l'estimateur des MCO

Propriétés exactes

Propriétés asymptotiques

Modèle de régression linéaire multiple
Détermination de l'estimateur
Propriétés de l'estimateur

Interprétation des coefficients
Variable explicative numérique
Autres types de variables
Plusieurs variables

Modalités de contrôle des connaissances et des compétences envisagées :

L'évaluation de cet enseignement relève du contrôle continu intégral. Un ensemble d'évaluations sont réalisées pendant plusieurs séances de cours magistral et de travaux dirigés.

Bibliographie recommandée :

Les étudiants sont systématiquement renvoyés à un ouvrage international de référence qui est à la base du cours. Sa lecture est recommandée tout au long du cours :

Stock J. et Watson M., Introduction to econometrics, Pearson 4^{ème} edition, 2017