

Intitulé de l'UE : **Econométrie**

Intitulé de l'enseignement (cours) : **Méthodes statistiques de l'économétrie**

Niveau Licence : **L3**

Semestre : **S6**

Volume horaire : 30h CM / 12h TD

Parcours : Economie Quantitative

Responsable(s) de l'enseignement (Nom et Prénom) : François LAISNEY

Tél. : 42 080

E-mail : fla@cournot.u-strasbg.fr

### Objectifs/Résumé :

Le cours aborde d'emblée les principes généraux, les modèles linéaires étant traités comme un cas particulier. Ce choix nécessite de la part des étudiants un effort soutenu dès le début : l'essentiel des outils nécessaires est présenté dans les deux premiers chapitres, pour être ensuite utilisé sous des formes diverses. Le niveau requis en mathématiques et statistique n'est cependant pas très élevé, la difficulté essentielle résidant dans l'extension aux cas vectoriel et matriciel de propriétés bien connues pour des fonctions ou des variables aléatoires réelles - et nombre de ces extensions sont également utilisées en économie, par exemple à propos de fonctions d'utilité, de fonctions de production ou de coût, ou encore de fonctions de demande de biens de consommation ou de facteurs de production.

### Plan :

1: Modèles statistiques et modèles économétriques: principes de la modélisation, modèles linéaires, exponentiels, contraste de Kullback, modèles latent, observable, conditionnel, exogénéité.

2: Rappels et compléments d'algèbre linéaire, de statistique et de théorie des probabilités: orthogonalité et projecteurs, régression linéaire, théorème de Frisch-Waugh [applications: données de panel, détection d'observations aberrantes], corrélation partielle, loi multinormale et dérivées: lien avec les projections.

3: Information et identification: exhaustivité, liberté, contraste de Kullback et information de Fisher [application: modèle logit conditionnel].

4: Généralités sur l'estimation et estimation sans biais: classes d'estimateurs, inégalité de Cramer-Rao, estimateurs sans biais optimaux, théorème de Gauss-Markov, moindres carrés ordinaires et généralisés, et cas où ils coïncident [application: systèmes de demande, modèles de panel.

5: Maximum de vraisemblance: propriétés asymptotiques et à distance finie, discussion des conditions de régularité [application: modèles à variable dépendante limitée: modèles logit, probit, tobit, modèle de déséquilibre].

6: Tests fondés sur la vraisemblance: tests de Wald, du score, du rapport de vraisemblance, test de Hausman et tests équivalents.

7: Prévision: généralités, prévision dans le modèle linéaire, résidus et résidus généralisés.

### Références bibliographiques :

Davidson, R. et J.G. MacKinnon (1993): Estimation and Inference in Econometrics, Oxford University Press.

Gouriéroux, C. et A. Monfort (1989): Statistique et Modèles économétriques, Economica, 2 volumes.

Mittelhammer, R., G. Judge and D. Miller (2000): Econometric Foundations, Cambridge University Press. <http://www.econometricfoundations.com/>

Intitulé de l'UE : **Politique Economique & Economie Internationale**

Intitulé de l'enseignement : **Economie internationale**

Niveau Licence : **L3**

Semestre : **S6**

Volume horaire : 24h CM

Parcours : Gestion, Analyse Economique et Economie Quantitative

Responsable(s) de l'enseignement : Claude SCHWOB

Tél. :

E-mail : schwob@cournot.u-strasbg.fr

Objectifs/Résumé :

Etudier les principales explications offertes par la théorie économique du niveau et de la structure des échanges internationaux de biens et services non financiers.

Etudier l'impact de l'ouverture des échanges commerciaux sur les prix des biens et services, sur les prix des facteurs de production et sur le bien-être des pays.

Ces deux thèmes sont abordés en utilisant les instruments de l'analyse microéconomique et de l'économie industrielle.

Plan :

Introduction : La problématique du commerce international

1<sup>ère</sup> partie : Les explications traditionnelles du commerce international

Chapitre 1 : Les différences de technologie

Chapitre 2 : Les différences de dotations factorielles

Chapitre 3 : Les approches néo-factorielles et néo-technologiques

2<sup>ème</sup> partie : Les explications contemporaines du commerce international

Chapitre 1 : Les économies d'échelle

Chapitre 2 : La différenciation horizontale des produits

Chapitre 3 : L'interaction stratégique entre firmes

Conclusion : La portée des principales explications du commerce international

Références bibliographiques :

De Melo – Grether : Commerce international – De Boeck 1997

Gandolfo : International Trade and Policies - Springer Verlag 1998

Mucchielli – Mayer : Economie internationale – Dalloz 2005

Intitulé de l'UE : <b>Micro-économie</b>		
Intitulé de l'enseignement (cours) : <b>Micro-économie Approfondie : Marchés concurrentiels</b>		
Niveau Licence : <b>L3</b>	Semestre : <b>S6</b>	Volume horaire : 30h CM / 12h TD
Parcours : Economie Quantitative		
Responsable(s) de l'enseignement (Nom et Prénom) : Isabelle MARET-LEIBER		
Tél. : 03.90.24.20.87		E-mail : <a href="mailto:maret@cournot.u-strasbg.fr">maret@cournot.u-strasbg.fr</a>

<p><u>Objectifs/Résumé :</u></p> <p>L'objet du cours est, dans un premier temps, d'approfondir l'étude (introduite en L1 et L2) des comportements individuels des agents économiques, consommateurs et producteurs, dans le modèle (de Arrow-Debreu-Mc Kenzie) de la concurrence pure et parfaite.</p> <p>Dans un second temps, il s'agira d'étudier l'interaction de ces comportements individuels dans une économie de production en situation de concurrence pure et parfaite, ce pour un nombre quelconque de biens et un nombre quelconque d'agents. Plus précisément, nous étudierons dans une telle économie le processus de détermination des prix et analyserons l'efficacité sociale de l'allocation à laquelle conduit le processus concurrentiel</p>
--

<p><u>Plan :</u></p> <p>INTRODUCTION PARTIE I : LE CONSOMMATEUR CONCURRENTIEL</p> <p>CHAPITRE I : La fonction de demande comme règle de choix CHAPITRE II : L'Axiome Faible des Préférences révélées CHAPITRE III : La rationalité individuelle CHAPITRE IV : Approche duale de la théorie du consommateur concurrentiel CHAPITRE V : La demande agrégée</p> <p>PARTIE II: LE PRODUCTEUR CONCURRENTIEL</p> <p>CHAPITRE VI : Ensemble de production et fonction de production CHAPITRE VII : Maximisation du profit CHAPITRE VIII : Approche duale du problème de décision du producteur concurrentiel CHAPITRE IX : L'offre agrégée et loi de l'offre</p> <p>PARTIE III : INTERACTION DES COMPORTEMENTS INDIVIDUELS</p> <p>CHAPITRE X: Equilibre concurrentiel d'une économie de production</p> <p><u>Références bibliographiques :</u></p> <ul style="list-style-type: none"><li>• <b>Deaton A. et Muellbauer J.</b>, <i>Economics and Consumer Behavior</i>, Cambridge University Press, Cambridge, 1980.</li><li>• <b>Tallon J.-M.</b>, <i>Equilibre Général : Une Introduction</i>, Vuibert, 1997.</li><li>• <b>Varian Hal R.</b>, <i>Analyse Microéconomique</i>, traduction de la 4ème édition, De Boeck Université, 1998.</li></ul>
--

Intitulé de l'UE : Parcours AE : **Intégration économique et Emploi** & Parcours EQ : **Economie du travail**  
Intitulé de l'enseignement (cours) : **Economie du travail et de l'emploi**

Niveau Licence : **L3**                      Semestre : **S6**                      Volume horaire : 20h CM  
Parcours : Analyse Economique et Economie Quantitative

Responsable(s) de l'enseignement (Nom et Prénom) : Stéphane ROBIN

Tél. : 03. 90.24.20.48                      E-mail : [robin@cournot.u-strasbg.fr](mailto:robin@cournot.u-strasbg.fr)

Objectifs/Résumé : (entre 5 et 10 lignes)

L'objectif de ce cours est de permettre aux étudiants d'acquérir une bonne connaissance des concepts fondamentaux de l'économie du travail. L'accent est mis dans un premier temps sur l'approche microéconomique du marché du travail. Les concepts du marché néoclassique (offre, demande, équilibre) sont revisités et étendus au bien « travail ». Sont ensuite présentées la théorie du capital humain et la théorie des différences compensatrices. Enfin, un chapitre est consacré aux concepts de *marché interne du travail* et de *segmentation du marché du travail*. Dans un deuxième temps, le cours propose un survol des approches macroéconomiques du marché du travail et des questionnements qui en découlent : approche keynésienne ; courbe de Philips et NAIRU ; critique de la synthèse keynésienne - néoclassique par l'Ecole de Chicago ; persistance du chômage.

Plan :

### **1. L'approche microéconomique standard et ses extensions**

- 1.1. L'offre de travail
- 1.2. La demande de travail
- 1.3. La formation des salaires et la théorie des différences compensatrices
- 1.4. La théorie du capital humain et la théorie du signal
- 1.5. Marchés interne / externe et primaire / secondaire

### **2. Les analyses macroéconomiques**

- 2.1. L'approche Keynesienne
- 2.2. La courbe de Philips et le NAIRU
- 2.3. Analyses des rigidités : l'approche de Chicago
- 2.4. Persistance du chômage

Références bibliographiques :

- Cahuc & Zylberberg (2001), *Le marché du travail*, De Boeck
- A. Perrot (1995), *Les nouvelles théories du marché du travail*, Repères – La Découverte

Intitulé de l'UE : **Croissance économique**

Intitulé de l'enseignement (cours) : **Croissance**

**Niveau Licence** : L3

Semestre : **S6**

Volume horaire : 24h CM / 12h TD

Parcours : Analyse Economique et Economie Quantitative

Responsable de l'enseignement : Théophile AZOMAHOU

Tél. : 03 90 24 22 22

E-mail : azomahou@cournot.u-strasbg.fr

### Objectifs/Résumé

Après une réflexion sur la nature, les sources et le rôle de la croissance dans les économies, le cours expose brièvement les principales théories de la croissance ainsi que leurs portées empiriques. Il approfondit ensuite la théorie de la croissance exogène et introduit quelques éléments de la croissance endogène.

### Plan

1. Fondamentaux de la croissance économique
2. Le modèle Keynésien de Harrod
3. Le modèle de Solow-Swan
4. La croissance optimale, Ramsey
5. Introduction à la croissance endogène

### Références bibliographiques

- Barro, R.J., Sala-i-Martin, X. (1996), La Croissance Economique, Ediscience International, McGraw Hill Book, New York.
- Blanchard, O.J., Fisher S. (1989), Lectures on Macroeconomics, Cambridge MIT Press.
- Hairault (2000), Analyse Macroéconomique, Tomes 1 et 2, La Découverte.
- Jones, C.I. (1998), Introduction to Economic Growth', W.W. Norton, New York.
- Maddison, A. (1991), Dynamic Forces in Capitalist Development, a Long Run Comparative View, Oxford University Press.
- Romer, D. (1997), Macroéconomie Approfondie, Ediscience International, McGraw Hill.

## **UE Econométrie appliquée.** Niveau L3 - Semestre S6

### **Cours : Econométrie appliquée**

#### **Résumé.**

L'enseignement d'Econométrie Appliquée s'appuie sur l'ouvrage de Berndt (1990) et sur le logiciel SHAZAM (1997). Le but de cet enseignement est de familiariser les étudiants avec une véritable pratique de l'économétrie, l'accent étant mis plus sur le passage entre un problème économique et la formulation des modèles statistiques adéquats que sur la simple mise en oeuvre pratique de méthodes économétriques. Les données fournies avec l'ouvrage de Berndt permettent aux étudiants de répliquer diverses études publiées, voir d'essayer d'améliorer ou d'affiner les résultats. Les premières séances de travaux pratiques seront consacrées à une initiation à l'utilisation du logiciel SHAZAM et à des illustrations des outils présentés dans les deux premiers chapitres du cours 'Méthodes statistiques de l'économétrie' : calcul matriciel, projections, génération de nombres pseudo-aléatoires, etc. Les thèmes qui seront abordés ensuite reposent sur certains chapitres de l'ouvrage de Berndt (1990). Pour chacun de ces thèmes, un résumé sera communiqué avec les feuilles des TP. Toutefois, il est conseillé vivement de se référer aux différents chapitres de l'ouvrage pour plus d'information.

#### **Plan /grandes lignes.**

Les thèmes abordés : Fonctions et Procédures matricielles ; Le modèle d'évaluation des actifs financiers ; Apprentissage et Economies d'échelle ; La mesure de la variation de la qualité d'un bien ; La formation des salaires ; etc.

#### **Références de base.**

Berndt E., 1990, The Practice of Econometrics : Classic and Contemporary, Addison-Wesley.  
SHAZAM, 1997, User's Référence Manual Version 8.0, McGraw-Hill.

## **UE Analyse de données.** Niveau L3 - Semestre S6

### **Cours : Analyse de données**

#### **Résumé.**

Quelques méthodes de traitements exploratoires des données. Initiation à un logiciel.

#### **Plan/Grandes lignes.**

Statistique Exploratoire ( "Analyse des Données") / Statistique Confirmatoire ( "Econométrie"). Traiter des données d'enquêtes. Penser, mesurer et représenter la nature et l'intensité des liens entre des variables qualitatives : l'Analyse Factorielle des Correspondances Multiples (AFCM). Penser, mesurer et représenter la nature et l'intensité des liens entre des variables numériques : l'Analyse en Composantes Principales (ACP). La production de typologies : Classifications Hiérarchiques Ascendantes (CHA)

#### **Références de base.**

Volle, M., 1997, *Analyse des données*, Dunod.

Dir.Govaert, G., 2003, *Analyse des données*, Lavoisier.

Escoffier, B et Pagès, J., 1998, *Analyses factorielles simples et multiples : objectifs, méthodes et interprétations*, Dunod.

## **UE Optimisation.** Niveau L3 - Semestre S6

### **Cours : Optimisation**

#### **Résumé.**

Le cours présente les principales techniques d'optimisation utilisées en économie. Il porte sur l'optimisation sans contraintes, l'optimisation avec contraintes égalités et inégalités, et insiste sur des thèmes plus spécifiques aux économistes et aux gestionnaires, à savoir l'optimisation convexe et quasi-convexe et la sensibilité des optima aux variations des valeurs des paramètres. Le cours intègre démonstrations et applications. Il précise notamment la signification géométrique des principaux théorèmes exposés, tels ceux de Weierstrass, Lagrange et Kuhn Tucker, et accorde une place centrale à la portée économique de ces théorèmes. Enfin, il entraîne les étudiants à écrire sous forme d'un problème d'optimisation des problèmes économiques courants.

#### **Plan /grandes lignes.**

Optimisation libre - optimisation sous contraintes égalités – optimisation sous contraintes inégalitésparamétrisation  
- optimisation convexe et quasi-convexe.

#### **Références de base.**

Simon C.P.and Blume L.,1994, *Mathematics for economists*, Norton &Company.  
Sundaram R.K.,1996, *A first course in optimization theory*, Cambridge University Press.

Intitulé de l'UE : <b>Intégration économique et Emploi</b>		
Intitulé de l'enseignement (cours) : <b>Théories de l'Intégration Economique</b>		
Niveau Licence : <b>L3</b>	Semestre : <b>S6</b>	Volume horaire : 20h CM / 10h TD
Parcours : Analyse Economique		
Responsable(s) de l'enseignement (Nom et Prénom) : Meixing DAI & Moïse SIDIROPOULOS		
Tél. : 03 90 24 20 78 ; 03 90 24 20 85      E-mail : <a href="mailto:dai@cournot.u-strasbg.fr">dai@cournot.u-strasbg.fr</a> ; <a href="mailto:sidiro@cournot.u-strasbg.fr">sidiro@cournot.u-strasbg.fr</a>		

<p><u>Objectifs/Résumé :</u></p> <p>Intégration économique est devenue aujourd'hui un phénomène mondial depuis le lancement de la Communauté européenne. Un ensemble de théories microéconomiques et macroéconomiques ainsi que des concepts spécifiques sont nécessaires pour comprendre le processus d'intégration économique. Dans ce cours, après avoir étudié les différents concepts de base et les étapes du processus d'intégration économique, nous étudions les méthodes d'intégration et les effets économiques des différentes formes d'intégration sur les marchés des biens, des services et des facteurs de production. Enfin, nous abordons les aspects macroéconomiques du processus d'intégration économique et les implications de l'intégration monétaire pour les politiques macroéconomiques.</p>
---

<p><u>Plan :</u></p> <p>Chapitre 1. Les formes et les étapes de l'intégration économique Chapitre 2. L'intégration des marchés des produits Chapitre 3. L'intégration des marchés des services Chapitre 4. L'intégration des marchés des facteurs de production Chapitre 5. Intégration monétaire et politiques macro-économiques Chapitre 6. La politique agricole commune</p> <p><u>Références bibliographiques :</u></p> <p>De Grauwe, Paul (1992), <i>The Economics of Monetary Integration</i>, Oxford University Press. Devoluy M. (eds.), 2004, <i>Politiques Economiques Européennes</i>, Editions du Seuil. Pelkmans J. (1997), <i>European Integration</i>, Longman.</p>
--

Intitulé de l'UE : **Monnaie & Finance**

Intitulé du cours : **Analyse monétaire et financière**

Niveau Licence : **L3**

Semestre : **S6**

Volume horaire : 24h CM / 12h TD

Parcours : Analyse Economique

Responsable de l'enseignement: : Koenig Gilbert

Tél. :

Résumé :

Un premier chapitre explique l'émergence des capacités et des besoins de financement des agents non financiers et spécifie les mécanismes d'ajustements entre ces capacités et ces besoins. Les comportements monétaires et financiers des agents non-financiers et des entreprises bancaires qui interviennent dans ces ajustements sont analysés dans les chapitres suivants dans des optiques microéconomique et macroéconomiques en cas de certitude et d'incertitude. Le rôle de ces comportements dans la détermination des équilibres sur les marchés d'actifs est étudié dans un dernier chapitre.

Plan :

Chapitre 1. Modalités et organisation du financement de l'activité économique

Section 1. Le cadre comptable de l'activité des agents non financiers

Section 2. La finance directe

Section 3. La finance indirecte

Section 4. Economie d'endettement et prédominance de la finance indirecte

Section 5. Economie de marchés financiers et intermédiation financière

Chapitre 2. Les comportements monétaires et financiers des agents non financiers

Section 1. Les comportements d'optimisation des résidents privés non financiers

Section 2. La préférence pour la liquidité en avenir certain

Chapitre 3. La préférence pour la liquidité en avenir incertain

Section 1. La préférence pour la liquidité régie par le motif de précaution

Section 2. La demande spéculative de monnaie fondée sur les désaccords des agents sur le taux d'intérêt futur

Section 3. La demande spéculative de monnaie et les comportements face au risque

Chapitre 4. Les comportements des banques commerciales et l'offre de crédit

Section 1. Un modèle de comportement bancaire

Section 2. L'équilibre de l'entreprise bancaire en concurrence parfaite

Section 3. L'équilibre de l'entreprise bancaire en concurrence imparfaite

Section 4. Le marché du crédit

Chapitre 5. Taux d'intérêt et marchés d'actifs

Section 1. Un modèle financier à trois actifs

Section 2. Le rôle du coût du capital

Référence bibliographique :

Koenig G. (2000), *Analyse monétaire et financière*, Economica.

## Licence Économie et Gestion

Intitulé de l'UE : <b>Histoire de la Pensée Economique</b>		
Intitulé de l'enseignement (cours) : <b>La pensée économique dans les textes : Analyse et Méthodes</b>		
Niveau Licence : <b>L3</b>	Semestre : <b>S6</b>	Volume horaire : 24h CM
Parcours : Gestion, Analyse Economique et Economie Quantitative		
Responsable(s) de l'enseignement (Nom et Prénom) : Ragib EGE		
Tél. : 03 90 24 21 12		
E-mail : ege@cournot.u-strasbg.fr		

### Objectifs/Résumé :

Ce cours a pour objectif de présenter l'évolution de la pensée économique depuis l'Antiquité grecque jusqu'à la moitié du 19<sup>ème</sup> siècle. L'économie politique est une discipline scientifique récente dans l'histoire de l'Europe. Le cours s'efforcera d'analyser les raisons pour lesquelles cette science a dû attendre le 18<sup>ème</sup> siècle pour se construire. La méthode qui est adoptée dans le cadre de ce cours d'Histoire de la pensée économique est la méthode d'**analyse de textes**. Même si la présentation du cours suit une démarche chronologique, pour chaque période un certain nombre d'auteurs représentatifs (avec leurs textes originaux) seront retenus et analysés. Dans une telle approche ce qui importe ce sont moins les idées générales, les écoles ou les doctrines économiques que les **concepts** qui sont élaborés par des auteurs précis à travers leur travail analytique.

### Plan :

Le cours est composé de quatre parties :

- 1<sup>ère</sup> partie : La pensée économique avant les Physiocrates
- 2<sup>ème</sup> partie : La Physiocratie et François Quesnay
- 3<sup>ème</sup> partie : L'Ecole classique anglaise
- 4<sup>ème</sup> partie : Le mouvement socialiste dans la première partie du 19<sup>ème</sup> siècle

### Références bibliographiques :

- BERAUD Alain et FACCARELLO Gilbert** (dir.) : *Nouvelle Histoire de la Pensée Economique*, Editions de la Decouverte, T.1, 1992
- HOLLANDER Samuel** : *Classical Economics*, Basil Blackwell, 1987.
- JESSUA Claude** : *Histoire de la Théorie Economique*, Presses Universitaires de France, 1991.
- SCHUMPETER Joseph A.** : *Histoire de l'analyse Economique (History of Economic Analysis)* NRF, Gallimard, 1983