Croissance et fluctuations

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 21,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > En savoir plus : Site web de la formation : <http://master.eipmc.free.fr/>

Présentation

Préambule : si, pour tenir compte de la situation sanitaire, des restrictions ou des contraintes sont imposées à l'Université Paris Nanterre ou à l'UFR SEGMI, tout ou partie des épreuves, contrôles de connaissances et examens terminaux de la session 1 et de la session 2, ainsi que des sessions de rattrapages, pourront se dérouler en mode distancé.

Le cours abordera les thématiques décrites ci-dessous.

1. Pourquoi les économies fluctuent-elles et autour de quoi ?
2. La notion de « choc » à travers le cadre standard de la demande et de l'offre agrégées
3. Le modèle RBC (*Real Business Cycle*) canonique
4. Programmation sous Dynare avec applications aux modèles RBC
5. Les modèles monétaires
6. Macroéconomie et économétrie bayésienne
7. L'analyse macroéconomique actuelle à partir des modèles DSGE (*Dynamic Stochastic General Equilibrium*)

Objectifs

L'objectif de ce cours est d'expliquer pourquoi et comment les systèmes économiques évoluent dans le temps. A cette fin, les principaux modèles macroéconomiques structurels permettant d'analyser les fluctuations économiques seront passés en revue et plusieurs applications empiriques seront présentées.

L'intérêt des modèles présentés est de mêler fondements microéconomiques, relations dynamiques et anticipations rationnelles. Ce cours permet ainsi de découvrir la modélisation macroéconomique telle qu'on peut la pratiquer aujourd'hui dans les milieux académique et institutionnel, au travers de l'approche de l'équilibre général dynamique. Les séances contiennent des sessions pratiques sur ordinateur avec des exercices de simulation et d'estimation.

Évaluation

Evaluation écrite.

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document.

Pré-requis nécessaires

Pré-requis : Bonnes compétences en économie quantitative, macroéconomie et mathématiques.

Compétences visées

Construire et utiliser un modèle macroéconomique structurel, développer un raisonnement d'analyse économique basé sur les théories microéconomique et macroéconomique, suivre la conjoncture.

Examens

Evaluation écrite.

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document.

Bibliographie

Barro R. et Sala-I-Martin X. (2003), *Economic Growth*, 2ème édition, MIT Press.

Drumetz F., Pfister C. et Sahuc J.-G. (2015), *Politique Monétaire*, De Boeck.

Gali J. (2008), *Monetary Policy, Inflation, and the Business Cycle*, Princeton University Press.

Hamilton J. (1994), *Time Series Analysis*, Princeton University Press.

Ljungqvist L. et Sargent T. (2012), *Recursive Macroeconomic Theory*, 3ème édition, MIT Press.

Romer D. (2002), *Advanced Macroeconomics*, McGraw Hill.

Smets F. et Wouters R. (2007), Shocks and Frictions in US Business Cycles: A Bayesian DSGE Approach, *American Economic Review*, 97, 586-606.

Wickens M. (2008), *Macroeconomic Theory*, Princeton University Press.

Woodford M. (2003), *Interest and Prices*, Princeton University Press.

Ressources pédagogiques

Travail sur ordinateur