

Modélisation macroéconomique

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 24,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français, Anglais
- > Niveau d'étude : BAC +4
- > Période de l'année : Enseignement septième 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 : <https://sites.google.com/view/m1ea/accueil>

Présentation

Ce cours porte sur l'analyse des fluctuations économiques de court terme, qui s'est profondément renouvelée depuis les années quatre-vingt. Elle s'inscrit dans le cadre de modèles d'équilibre général intertemporel stochastique et se caractérise par une méthodologie d'évaluation originale qui repose sur la confrontation du modèle aux faits. Le cours présente la méthodologie d'évaluation, avant de montrer comment les insuffisances patentées des premiers modèles ont permis d'enrichir le cadre d'analyse, tant sur le plan théorique que méthodologique.

Objectifs

Le cours s'appuie sur une activité d'initiation à la recherche, qui permet à l'étudiant de se familiariser à la démarche scientifique. Au-delà de son contenu disciplinaire, cette activité de recherche doit permettre l'acquisition de compétences en lien avec l'observation et l'analyse des principaux faits économiques

Évaluation

Session 1 : évaluation sur dossier

Session 2 : évaluation sur dossier

Pré-requis nécessaires

Appétence pour les techniques quantitatives et l'économie, savoir lire un article en anglais

Compétences visées

A l'issue du cours, l'étudiant saura

- * Définir les fluctuations économiques à partir de caractéristiques qualitatives et quantitatives (en particulier en utilisant le filtre de Hodrick et Prescott).
- * Maîtriser et manipuler les modèles des cycles réels.

Bibliographie

- * Finn Kydland, Edward C. Prescott. 1980. A Competitive Theory of Fluctuations and the Feasibility and Desirability of Stabilization Policy in Stanley Fischer, editor, Rational Expectations and Economic Policy, p. 169 - 198
- * Ellen R. McGrattan and Edward C. Prescott 2014 A Reassessment of Real Business Cycle Theory, The American Economic Review, Vol. 104, No. 5, pp. 177-182

Ressources pédagogiques

Supports de cours en ligne

Articles académiques