

Croissance et fluctuations

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 21,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +5
- > 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
- > Code ELP : 5EgECCRF
- > En savoir plus : Site du master EIPMC <http://master.eipmc.free.fr>

Présentation

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. Les modèles monétaires avec frictions financières
5. L'analyse macroéconomique actuelle à partir des modèles DSGE (Dynamic Stochastic General Equilibrium)
6. Les fluctuations liées aux chocs climatiques et à la transition environnementale

Objectifs

Ce cours a pour objectif d'expliquer les mécanismes à l'origine des fluctuations et de la dynamique des systèmes économiques. À cette fin, les principaux modèles macroéconomiques structurels utilisés en analyse conjoncturelle et en politique économique

seront présentés, ainsi que plusieurs applications empiriques. Une attention particulière sera accordée aux fondements microéconomiques des comportements, aux interactions dynamiques et au rôle des anticipations rationnelles. Le cours abordera également l'impact macroéconomique des catastrophes naturelles et des politiques de transition vers une économie bas-carbone. Il permettra ainsi aux étudiants de se familiariser avec les outils de modélisation macroéconomique mobilisés aujourd'hui dans les milieux académiques et les institutions économiques, notamment dans le cadre des modèles d'équilibre général dynamique. L'enseignement pourra inclure des séances pratiques sur ordinateur consacrées à des exercices de simulation.

Évaluation

SESSION 1 :

Contrôle Terminal

- Type : Écrit
 - Durée : 2h00
- Régime Dérogatoire
- Type : Écrit
 - Durée : 2h00

SESSION 2 :

- Type : Écrit
- Durée : 2h00

Utilisation de l'intelligence artificielle :

Interdite à l'examen

Pré-requis nécessaires

Bonnes connaissances en économie quantitative, macroéconomie et mathématiques.

Compétences visées

- Comprendre et mobiliser un modèle macroéconomique structurel ;
- Réaliser des exercices de simulation et d'analyse de scénarios ;
- Développer un raisonnement en équilibre général ;
- Analyser les fluctuations conjoncturelles et les déterminants de la croissance de long terme ;

- Appréhender les effets macroéconomiques des chocs climatiques et de la transition vers une économie bas-carbone.

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 possible sur ordinateur