

Finance internationale approfondie

Infos pratiques

- > ECTS : 4.5
- > Nombre d'heures : 40.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Période de l'année : Enseignement huitième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > 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

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 distancié.

Ce cours traite de l'analyse de trois problèmes macroéconomiques importants dans les économies ouvertes: les taux de change, les flux de capitaux et les crises financières. Les objectifs du cours sont de présenter et d'évaluer les principales théories, modèles et travaux empiriques économiques pertinents dans ces trois domaines. Les modèles économétriques destinés à comprendre ces phénomènes seront présentés, notamment les modèles structurel VAR. Plus en détail, le cours explorera la balance des paiements, les taux de change et leur détermination, ainsi que la mondialisation financière et l'impacte des politiques monétaires de la BCE et de la FED sur les économies émergentes.

Objectifs

- Expliquer l'organisation et les détails institutionnels des marchés de change et des marchés monétaires internationaux.
- Expliquer et appliquer les théories des taux de change et de la macroéconomie de l'économie ouverte
- Analyser les causes des mouvements historiques des taux de change et certains des facteurs contributifs à diverses crises financières
- Savoir utiliser les modèles économétriques adaptés afin de comprendre le fonctionnement de la finance internationale

Évaluation

Evaluation écrite (partiel) et réplique d'article de recherche (en TD)

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

- Économétrie 2
- Marchés financiers
- Économie internationale

Compétences visées

- Utilisation des logiciels statistiques afin d'estimer un modèle de finance internationale
- Faire le lien entre la théorie et l'empirique
- Présenter les grands enjeux contemporains et les problèmes causés par la globalisation financière

Examens

Evaluation écrite (partiel) et réplique d'article de recherche (en TD)

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

Bibliographie

- Paul Krugman, Maurice Obstfeld, Economie internationale, 9e édition, Pearson, 2012
- Lutz Kilian and Helmut Lütkepohl, Structural Vector Autoregressive Analysis', Cambridge University Press, 2017

Ressources pédagogiques

Classe interactive

- Articles de recherche, presse
- Bibliothèque universitaire
- Un notebook pour répliquer les modèles économétriques

Contact(s)

> Thomas Chuffart

Responsable pédagogique
tchuffart@parisnanterre.fr