

# Modélisation macroéconomique contemporaine

## 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 distancié.*

Le cours présente de façon approfondie différents modèles macroéconomiques contemporains (DSGE), en se basant sur des articles de recherche fondateurs et/ou récents. Le cours met l'accent sur les implications empiriques du relâchement progressif d'un certain nombre d'hypothèses théoriques standards. Un premier chapitre résitue la modélisation macroéconomique contemporaine dans l'histoire de la macroéconomie depuis Keynes, en rappelle les principales hypothèses, et propose des rappels d'optimisation dynamique. Un deuxième chapitre met l'accent sur le relâchement de l'hypothèse de flexibilité des prix et de concurrence pure et parfaite, et en présente les implications empiriques, notamment en termes de politique monétaire. Enfin, un troisième chapitre porte sur le relâchement de l'hypothèse d'information

parfaite et symétrique, ce qui permet d'expliquer le rôle croissant des facteurs financiers dans l'explication des cycles économiques (mécanisme d'accélérateur financier) et le rôle des anticipations non-rationnelles (mécanismes d'apprentissage) pour rendre compte de la persistance observée dans les variables macroéconomiques et financières.

## Objectifs

L'objectif du cours est de décortiquer certains modèles macroéconomiques standards contemporains pour en comprendre les principales hypothèses, les méthodes de résolution et les implications empiriques, en mettant l'accent sur le rôle de la politique monétaire dans les fluctuations économiques, le rôle des facteurs financiers, et le rôle des frictions informationnelles. Le cours doit aussi permettre aux étudiants de résituer la modélisation macroéconomique contemporaine dans l'histoire de la pensée économique et de développer un esprit critique quant à la modélisation macroéconomique contemporaine, afin d'en identifier aussi bien les principaux apports que les principales limites.

## 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 : Connaissances niveau L3 et M1 en macroéconomie dynamique et optimisation intertemporelle

## Compétences visées

- Maîtriser les principales hypothèses et méthodes des modèles macroéconomiques récents visant à expliquer les fluctuations de court terme (modèles DSGE)

- Etre capable de résituer ces modèles contemporains dans l'histoire de la pensée macroéconomique depuis la fin du consensus keynésien dans les années 1970
- Comprendre les raffinements récents de la modélisation macroéconomique contemporaine et saisir en quoi ils ont été inspirés par les développements récents de la microéconomie
- Savoir établir les conditions d'équilibre de différents modèles macroéconomiques dynamiques et connaître les méthodes de résolution numérique de ce type de modèles
- Pouvoir discuter la capacité de ces modèles à expliquer les fluctuations empiriques et leurs implications en termes de politique économique
- Connaître les principales limites de la modélisation macroéconomique contemporaine standard et les différents types de critiques qui lui sont adressées par d'autres courants de pensée
- Etre capable de développer un esprit critique et une réflexion personnelle à propos des principaux postulats et méthodes de la macroéconomie contemporaine

## 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

---

- Gali, J., *Monetary Policy, Inflation and the Business Cycle. An Introduction to the New Keynesian Framework*, 2ème éd., Princeton University Press, 2015.
- De Vroey, M. and Malgrange, P., "Théorie et modélisation macro-économiques, d'hier à aujourd'hui", *Revue Française d'Economie*, 2017
- Vines, D. and Wills, S., "Rebuilding macroeconomic theory", *Oxford Review of Economic Policy*, Vol. 1-2, 2018
- Blanchard, O., 'Do DSGE Models Have a Future?', Peterson Institute for International Economics Policy Brief, 2016

## Ressources pédagogiques

---

Classe interactive

# Contact(s)

## > Pauline Gandre

Responsable pédagogique  
pgandre@parisnanterre.fr