

Master Économie

Cycles macroéconomiques

Responsable	Descriptions	Informations
Frederic DUFOURT frederic.dufourt@univ-amu.fr	Code : BECCV4A Nature : Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion Nombre de crédits :

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

CONTENU

L'objectif du cours est d'apprendre à analyser théoriquement et numériquement les modèles dynamiques à temps discret en anticipations rationnelles. Des applications dans le champ de la Théorie des Cycles Réels (RBC models) et des modèles d'équilibre général dynamique et stochastiques (DSGE models) seront présentées. Le cours propose aussi des sessions sur ordinateur durant lesquelles les concepts seront appliqués et mis en œuvre en utilisant le logiciel Matlab.

Plan du cours détaillé :

Chap 1. Prolongements de la Théorie des Cycles Réels

1. Le modèle RBC : principaux résultats et premières critiques
2. Extensions dans le domaine du marché du travail
3. Taux d'utilisation variable des facteurs de production
4. Coûts d'ajustement du capital et dynamique de l'investissement
5. Combiner les sources d'incertitude

Chap 2. Résolution et estimation des modèles DSGE

1. Modèles dynamiques linéaire en anticipations rationnelles : solution(s), unicité/multiplicité, stabilité
2. Résolution des modèles DSGE par méthode de perturbations au 1er ordre : log-linéarisation autour de l'état stationnaire
3. Méthodes d'estimation : un survol

Chap 3. Sessions sur ordinateur

1. Session 1
2. Session 2

Chap 4. Méthodes globales : Itération sur la fonction valeur et applications (si temps disponible)

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Comprendre les modèles de cycles réels
- Savoir résoudre et estimer les modèles DSGE
- Applications sur le logiciel Matlab

MODALITÉS D'ORGANISATION

8 cours de 3h, parmi lesquels deux cours dédiés aux applications sur ordinateur.

Evaluation finale sous forme d'un examen écrit.

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Farmer, R., *Macroeconomics of Self-Fulfilling Prophecies*, 2nd edition, MIT Press, 1999.
- King, R. and S. Rebelo, "Resuscitating real business cycles", *Handbook of Macroeconomics*, 1999, vol. 1, Part B, pp 927-1007.
- Dejong, D. and C. Dave, *Structural Macroeconometrics*, 2nd edition, Princeton University Press, 2011.
- Canova, F., *Methods for applied Macroeconometric Research*, Princeton University Press, 2007.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

Connaissances de base en économie et mathématiques pour des étudiants en Économie de niveau M1 (modèles de choix intertemporels, optimisation, etc.)

PRÉREQUIS RECOMMANDÉS

Cours de macroéconomie de niveau Licence.
Cours de macroéconomie avancée de niveau M1.

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures
- Cours magistraux: 24 heures

CODES APOGÉE

- BECC05A [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)



Dernière modification le 30/06/2023