Economie des modèles à changement de régime

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

- Econométrie des séries temporelles,
- Modèles à changement de régime (MCR)
- Maîtrise d'outils économétriques permettant de capter les sauts des séries macroéconomiques et financières en vue de faire de la datation cyclique, d'identifier les phases haussières ou baissières des marchés, de repérer des bulles spéculatives dans la dynamique des prix, etc

Compétence à acquérir :

Simulation, estimation et tests des MCR sous Matlab