

Economie des modèles à changement de régime

**ECTS** : 3

**Description du contenu de l'enseignement :**

- Économétrie 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

**Document susceptible de mise à jour - 18/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL** - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16