Méthodes et données de l'analyse macroéconomique

ECTS : 6

Enseignant responsable : Fabien TRIPIER (https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/tripier-fabien)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 36

Description du contenu de l'enseignement :

Le cours vise à former les étudiants aux méthodes et données de l'analyse macroéconomique. La première partie, assurée par le responsable du cours, présente les principales méthodes de l'analyse macroéconomique. L'objectif de cette partie est double. Premièrement, amener les étudiants à maîtriser ces méthodes dans leur version la plus simple, y compris à partir d'applications concrètes utilisant les logiciels appropriés. Deuxièmement, apporter aux étudiants les bases requises pour l'interprétation des résultats présentés à partir de ces méthodes dans les articles de recherche et les publications des institutions de politique économique. Cette partie cours est organisé de la manière suivante.

1. Les faits stylisés du cycle économique
2. La théorie néoclassique du cycle économique
3. La théorie keynésienne du cycle économique
4. Les règles de politique monétaire
5. Macroéconométrie (VAR structurel, projection locale et identification des chocs)

Durant la seconde partie du cours, des intervenants externes présenteront des applications de l'analyse macroéconomique réalisées au sein de leurs organismes. L'objectif de cette partie est également de montrer la grande diversité des sources de données utilisées pour l'analyse macroéconomique et comment elles sont mobilisées en période de crise économique. Les interventions porteront sur les thèmes suivants.

1. L'apport des données d'enquête à la macroéconomie
2. L'apport des données microéconomiques à la macroéconomie
3. Les modèles de prévision et leur utilisation en période de crise
4. L'intégration des risques immobiliers dans l'analyse macroéconomique
5. L'intégration des risques bancaires dans l'analyse macroéconomique

Compétences à acquérir :

Modélisation du cycle économique. Etude des données macroéconomiques. Analyse des politiques économiques.

Pré-requis recommandés

Macroéconomie, économétrie.

Mode de contrôle des connaissances :

Examen écrit

Coefficient : 6.00

Bibliographie, lectures recommandées :

· Blanchard, O. (2018). On the future of macroeconomic models. Oxford Review of Economic Policy 34(1-2), 43-54. · King, R. G. and S. T. Rebelo (1999). Resuscitating real business cycles. Handbook of macroeconomics 1, 927-1007. · Galí, J. (2015). Monetary policy, in?ation, and the business cycle: an introduction to the new Keynesian framework and its applications. Princeton University Press. · Kilian, L. and H. Lütkepohl (2017). Structural vector autoregressive analysis. Cambridge University Press. · Ramey, V. A. (2016). Macroeconomic shocks and their propagation. In Handbook of macroeconomics, Volume 2, pp. 71-162. Elsevier.