

PLAN DE COURS

ECN-7610 : Analyse macroéconomique appliquée

NRC 14462 | Hiver 2019

Mode d'enseignement : Présentiel

Temps consacré : 3-0-6	Crédit(s) : 3
------------------------	---------------

Ce cours étudie le modèle néokeynésien, un cadre d'analyse sous-tendant les projections par lesquelles nombre de banques centrales, dont la Banque du Canada, analysent leurs choix de politique. L'objectif du cours est de comprendre les différentes facettes du modèle, de mettre en pratique les méthodes de solution quantitatives sur informatique appliquée à ce type de modèle et de fournir aux étudiants l'expertise nécessaire pour utiliser ce modèle et évaluer différentes problématiques de politique monétaire ou fiscale.

Plage horaire

Cours en classe			
lundi	15h30 à 18h20	DES-2225	Du 14 janv. 2019 au 26 avr. 2019

Il se peut que l'horaire du cours ait été modifié depuis la dernière synchronisation avec Capsule. [Vérifier l'horaire dans Capsule](#)

Site de cours

<https://sitescours.monportail.ulaval.ca/ena/site/accueil?idSite=103978>

Coordonnées et disponibilités

Isabelle St-Pierre
isabelle.st-pierre@fss.ulaval.ca

Kevin Moran
Enseignant
kevin.moran@ecn.ulaval.ca

Soutien technique

CSTIP - Centre de services en TI et pédagogie

Pavillon Charles-De Koninck, local 0248

aide@cstip.ulaval.ca

Téléphone : 418-656-2131 poste 405222

HORAIRE RÉGULIER

DU LUNDI AU JEUDI

De 8h à 12h et de 13h à 21h30

VENDREDI

De 8h à 12h et de 13h à 17h

SAMEDI

De 8h à 12h et de 13h à 16h45

En contactant le soutien informatique, il est possible qu'il vous soit demandé d'utiliser l'application de contrôle à distance, Team Viewer. Si tel est le cas, voici les liens pour exécuter celle-ci :

[Accédez à TeamViewer pour Windows](#)

[Accédez à TeamViewer pour Mac](#)

Sommaire

Description du cours	4
Présentation générale	4
Objectif général du cours	4
Approche pédagogique	4
Plan détaillé	4
Contenu et activités	4
Évaluations et résultats	5
Liste des évaluations	5
Informations détaillées sur les évaluations sommatives	5
Travaux pratiques	5
Présentation en classe	5
Examen de mi-session	5
Barème de conversion	6
Règlements et politiques institutionnels	6
Politique à l'égard des retards aux évaluations	7
Politique en matière d'absence aux évaluations	7
Étudiants ayant un handicap, un trouble d'apprentissage ou un trouble mental	7
Matériel didactique	7
Liste du matériel complémentaire	7
Spécifications technologiques	8
Logiciels	8
Bibliographie et annexes	8
Bibliographie	8

Description du cours

Présentation générale

Les modèles dits de cycles réels (Kydland et Prescott, 1982) ont révolutionné l'analyse macroéconomique dans le courant des années 1980. Ces modèles sont construits autour de l'hypothèse centrale selon laquelle les différents agents économiques (ménages, entreprises, etc.) prennent leurs décisions dans un contexte d'optimisation dynamique avec une vision prospective du futur. Dans le contexte des modèles de cycles réels, les agrégats macroéconomiques tels que la consommation, l'épargne, les décisions d'offre de travail, etc. découlent donc tous des solutions à ces problèmes de maximisation et les anticipations à propos des conditions économiques futures jouent naturellement un rôle-clé dans ces décisions.

Le modèle *néokeynésien* trouve son origine dans ce cadre d'analyse. Il en a gardé les fondements méthodologiques (optimisation, vision prospective) mais a étendu les champs d'analyse dans des directions que les modèles de cycles réels pouvaient difficilement explorer, notamment l'analyse de la politique monétaire. Dans ce contexte, le modèle *néokeynésien* met l'emphase d'abord sur une série de rigidités qui contraignent l'évolution de variables macroéconomiques tel que les prix et les salaires et, d'autre part sur le comportement des autorités monétaires.

Le modèle néokeynésien constitue désormais le socle de base des modèles de projections par lesquels la plupart des banques centrales, dont la Banque du Canada, analysent leurs choix de politique.

Objectif général du cours

Ce cours vise à (i) présenter le modèle néo-keynésien, (ii) en analyser et comprendre les différentes facettes, (iii) à mettre en pratique les méthodes de solutions quantitatives sur informatique appliquées à ce type de modèle, et (iv) fournir aux étudiants l'expertise nécessaire pour utiliser et développer ce cadre d'analyse en évaluant différentes problématiques liées à la politique monétaire et la politique fiscale.

Dans ce contexte, le cours sera divisé en plusieurs modules utilisant le modèle néokeynésien comme trame de fond commune pour discuter de plusieurs thèmes. Les aspects pratiques (solution quantitative avec **Matlab** et **Dynare** seront au coeur de l'apprentissage.

Approche pédagogique

Le déroulement du cours s'effectuera en deux grandes étapes. Premièrement, le modèle néokeynésien dans sa forme épurée (peu de variables d'états, formes paramétriques simplifiées, etc) sera présentée, de manière à bien développer l'intuition nécessaire à une bonne compréhension. Cette étape se basera largement sur les premiers chapitres du livre de Gali (voir ci-dessous).

La deuxième étape prendra un aspect plus pratique et consistera en un approfondissement de l'intuition, des extensions au modèle simple (ajouts de secteurs, formes paramétriques plus complexes, etc.) et des exercices pratiques de résolution et simulation de modèle sur ordinateur.

Plan détaillé

Voir plan de cours sous l'onglet *Contenu et activités*

Contenu et activités

Le tableau ci-dessous présente les semaines d'activités prévues dans le cadre du cours.

Titre	Date
Introduction et plan de cours	
Notes à propos du livre de Gali	

Modèles néo-keynésiens: solution sur ordinateur	
Programmation dynamique	
Moments non-conditionnels dans les données	
Extensions du modèle simple RBC	
Solutions de premier ordre	

Note : Veuillez vous référer à la section *Contenu et activités* de votre site de cours pour de plus amples détails.

Évaluations et résultats

Liste des évaluations

Sommatives			
Titre	Date	Mode de travail	Pondération
Travaux pratiques	À déterminer	Individuel	40 %
Présentation en classe	À déterminer	Individuel	20 %
Examen de mi-session	Le 11 mars 2019 de 15h30 à 18h20	Individuel	40 %

Informations détaillées sur les évaluations sommatives

Travaux pratiques

Date de remise : À déterminer

Mode de travail : Individuel

Pondération : 40 %

Directives de l'évaluation :

Travaux pratiques (40%). Ces travaux comporteront une composante analytique (résolution de modèle), une composante pratique (simulation des modèles sur ordinateur) et une composante écrite (rédaction d'un court rapport de recherche). Un problème étudié en classe sera modifié dans une direction donnée et les conséquences de cette modification seront déterminées par l'étudiant. Le logiciel utilisé est Mat-lab. Les étudiants sont encouragés à échanger entre eux à propos des exercices mais doivent remettre chacun un travail distinct. Le traitement de texte utilisé pour écrire le travail devrait être de la famille LATEX.

Présentation en classe

Date de remise : À déterminer

Mode de travail : Individuel

Pondération : 20 %

Directives de l'évaluation :

Présentations en classe (20%). Après avoir lu et travaillé sur un papier, l'étudiant présentera en classe un résumé du papier et des principaux enseignements à en tirer.

Examen de mi-session

Date : Le 11 mars 2019 de 15h30 à 18h20
Mode de travail : Individuel
Pondération : 40 %
Directives de l'évaluation : Examen de mi-session (40%). L'examen aura lieu en classe le mercredi 11 mars 2019. Il portera sur la matière couverte jusqu'au dernier cours avant l'examen.

Barème de conversion

Cote	% minimum	% maximum
A+	90	100
A	85	89,99
A-	80	84,99
B+	75	79,99
B	70	74,99
B-	65	69,99

Cote	% minimum	% maximum
C+	60	64,99
C	50	59,99
E	0	49,99

Règlements et politiques institutionnels

Règlement disciplinaire

Infractions relatives au bon ordre

Tout étudiant a une obligation de bon comportement dans un lieu universitaire ou à l'occasion d'une activité universitaire.

Infractions relatives aux études

Dans le but de préserver la crédibilité des attestations ou des diplômes délivrés et afin de s'assurer que les relevés de notes et les diplômes témoignent de la compétence et de la formation réelle des étudiants, il est interdit d'avoir des comportements répréhensibles associés au plagiat.

Pour en connaître davantage sur le plagiat et ses formes, vous pouvez consulter le site du [Bureau des droits étudiants](#), la capsule d'information [Citer ses sources et éviter le plagiat](#) et le site de la [Bibliothèque](#) pour savoir comment citer vos sources.

Tout étudiant qui commet une infraction au *Règlement disciplinaire à l'intention des étudiants de l'Université Laval* dans le cadre du présent cours, est passible des sanctions qui sont prévues dans ce règlement.

Consultez le règlement à l'adresse suivante : <http://ulaval.ca/reglement-disciplinaire>

Harcèlement et violence à caractère sexuel

La Faculté des sciences sociales condamne toute manifestation de harcèlement psychologique, de harcèlement sexuel et de toute autre forme de violence à caractère sexuel. Dans le cadre des activités universitaires sous sa responsabilité, elle s'engage à prendre tous les moyens à sa disposition pour prévenir les conduites (comportements, paroles, actes ou gestes) qui portent atteinte à la dignité ou à l'intégrité psychologique ou physique, les faire cesser et sanctionner.

Consultez le règlement à l'adresse suivante : <http://ulaval.ca/reglement-prevention-harcelement>

Visitez le site du Centre de prévention et d'intervention en matière de harcèlement : <https://www2.ulaval.ca/services-ul/harcelement.html>

Politique et directives relatives à l'utilisation de l'œuvre d'autrui aux fins des activités d'enseignement, d'apprentissage, de recherche et d'étude privée à l'Université Laval

L'Université s'est dotée d'une politique institutionnelle sur le droit d'auteur le 1er juin 2014. Les enseignants doivent effectuer par eux-mêmes une saine gestion de l'utilisation de l'œuvre d'autrui, et ce, en conformité avec la *Loi sur le droit d'auteur*.

La Politique a pour objet d'énoncer l'importance que l'Université accorde à la protection des droits des auteurs, d'établir les choix prioritaires qui doivent être faits par le Personnel enseignant relativement à l'utilisation de l'Œuvre d'autrui aux fins des activités d'enseignement, d'apprentissage, de recherche et d'étude privée et de définir un concept administratif de l'utilisation équitable de l'Œuvre d'autrui à ces fins.

Consultez la politique à l'adresse suivante : http://www.bibl.ulaval.ca/fichiers_site/bda/politique-oeuvre-autrui-ca-2014-85.pdf

Politique à l'égard des retards aux évaluations

Les étudiants sont invités à prendre connaissance de la Politique du Département à l'égard des retards aux évaluations https://www.ecn.ulaval.ca/sites/ecn.ulaval.ca/files/Reglements/politique_retard.pdf. Suivant les règles de cette politique, l'étudiant qui se présente en retard à un examen pourrait ne pas être admis.

Politique en matière d'absence aux évaluations

Les étudiants sont invités à prendre connaissance de la politique du Département d'économique à l'égard des absences aux évaluations <http://www.ecn.ulaval.ca/fr/etudes/reglement-des-etudes>. Une absence non justifiée suivant les règles de cette politique entrainera une note de zéro à l'évaluation manquée.

Étudiants ayant un handicap, un trouble d'apprentissage ou un trouble mental

Les étudiants qui ont une **Lettre d'attestation d'accommodations scolaires** obtenue auprès d'un conseiller du **secteur Accueil et soutien aux étudiants en situation de handicap (ACSESH)** doivent rencontrer leur professeur au **début de la session** afin que des mesures d'accommodement en classe ou lors des évaluations puissent être mises en place.

Ceux qui ont une déficience fonctionnelle ou un handicap, mais qui n'ont pas cette lettre doivent contacter le **secteur ACSESH** au (418) 656-2880, le plus tôt possible.

Le secteur ACSESH vous recommande fortement de vous prévaloir des services auxquels vous avez droit afin de pouvoir réussir vos études, sans discrimination ni privilège. Vous trouverez plus de détails sur ces services à l'adresse suivante: www.aide.ulaval.ca/situation-de-handicap/presentation/

Pour plus d'informations sur les évaluations, consultez la *Procédure de mise en application des accommodations ayant trait à la passation des examens pour les étudiants ayant une déficience fonctionnelle*:

https://www.sgc.ulaval.ca/files/content/sites/aide/files/files/integration/depliant_acc_scolaire_dec2012.pdf

Matériel didactique

Liste du matériel complémentaire



Monetary Policy, Inflation, and the Business Cycle, Second Edition (2e édition)

Auteur : Jordi Gali

ISBN : 9780691164786

https://www.amazon.ca/Monetary-Policy-Inflation-Business-Cycle/dp/B012HTX8ZU/ref=sr_1_fkmr0_2?ie=UTF8&qid=1515874441&sr=8-2-fkmr0&keywords=jordil+gali+monetary+policy



Monetary Theory and Policy (4e édition)

Auteur : Carl E Walsh

Éditeur : The MIT Press

ISBN : 9780262035811

https://www.amazon.ca/Monetary-Theory-Policy-Carl-Walsh/dp/0262035812/ref=sr_1_1?s=books&ie=UTF8&qid=1515875074&sr=1-1&keywords=carl+walsh+monetary+policy

Advanced Macroeconomics (2ieme édition)



Auteur : Romer, D.
Éditeur : McGraw-Hill Irwin. (2001)
ISBN : 0072318554

Il n'y a pas de manuel obligatoire pour suivre le cours. Les notes données en classe et qui seront rendues disponibles sur ENA contiennent l'essentiel de la matière provenant du livre de Gali (voir ci-dessous). Toutefois, les manuels ci-dessous peuvent apporter une information complémentaire utile à la matière couverte en classe. Les avoir à portée de main comme référence pourrait donc s'avérer très utile.

Spécifications technologiques

Afin d'accéder sans difficulté au contenu de votre cours sur monPortail, vous devez vous référer aux informations ci-dessous.

Liste des navigateurs supportés :

- [Google Chrome](#)
- [Mozilla Firefox](#)
- Safari
- Internet Explorer 11 et plus
- [Opera](#)

Appareils mobiles

Il est important de préciser que l'utilisation des périphériques mobiles n'est pas officiellement supportée pour les sites de cours. La consultation des contenus est fonctionnelle pour la plupart des appareils sous Android et iOS, mais il existe certaines limites :

- les appareils mobiles sous Windows RT, BlackBerry et les iPhone 4 et 4S ne sont pas supportés;
- le contenu Flash n'est pas supporté, ce qui empêche la consultation des blocs de contenu audio-vidéo, de contenu Flash et de certaines présentations multimédias;
- la fonctionnalité de glisser-déposer n'est pas supportée, ce qui empêche la réalisation de certains questionnaires.

Team Viewer

TeamViewer est l'application utilisée par le CSTIP pour faire du soutien à distance. En exécutant cette application, vous permettez à un agent de soutien informatique de se connecter à votre poste pour vous aider.

- [Accédez à TeamViewer pour Windows](#)
- [Accédez à TeamViewer pour Mac](#)

Logiciels

L'analyse informatique sera effectuée sur Matlab et Dynare. Matlab est un langage de programmation couramment utilisé à des fins de calculs numériques en science naturelles, génie, économique et finance <https://www.mathworks.com/products/matlab.html>

D'autre part, Dynare est un logiciel gratuit utilisant les capacités de Matlab <http://www.dynare.org>

Notez qu'un clone gratuit de Matlab existe et s'appelle Octave <https://www.gnu.org/software/octave/> Dynare fonctionne également sur Octave.

Bibliographie et annexes

Bibliographie

Cette sous-section n'a pas encore été complétée par votre enseignant.

