

ECONOMETRIE du TAUX DE CHANGE



Appel à communications
Date limite : 15/01/05

90^{ème} Colloque International

les 07 et 08 avril 2005

Comité scientifique : Pavlos KARADELOGLOU

AEA, Banque Centrale Européenne

S. Avouyi Dovi (BdF), J. Bailliu (Banque du Canada), M. Beine (Dulbea), J. Closterman (U. of Ingolstadt), V. Coudert (Banque de France), Z. Darvas (Bank of Hungary), S. Kamburov (Bank of Russia), H. S. Kim (Bank of Korea), M. Kohler (Reserve Bank of Australia) C. Kyrtsov (U. Macedoine), D. Nautz (Frankfurt University), G. Paladino (SanPaolo IMI), Roma), P. Pieretti (U. du Luxembourg), H. Serbat (AEA), V. Terraza (U. Luxembourg), J.Toth (ING Bank, Slovakia)

Comité local d'organisation : Virginie TERRAZA

Luxembourg School of Finance U. Luxembourg

S. Allegrezza (Min. Finances); A. Sadler (Arcelor), ...

Conférences magistrales :

Guy Dollé Arcelor CEO et Sirkka Hamalainen (tbc)

THÈMES :

1. Impacts du taux de change sur l'économie

1. Monnaie unique et commerce (zone euro, pays tiers)
2. Sensibilité des résultats des entreprises aux variations de change
3. Influence des variations de change sur les cours des matières premières
4. Rôle du taux de change dans les ajustements de tarifs des biens à l'exportation

2. Explication et prévision des variations du Taux de change

1. Facteurs explicatifs du taux de change à court, moyen, long terme
2. Prévision de taux de change
3. Intégration financière, stratégies d'investissement financière et détermination du taux de change
4. Mouvements des capitaux et détermination du taux de change
5. Pass-through et son évolution dans le temps
6. Facteurs expliquant le pass-through (composition du commerce, comportement de prix etc)
7. Taux de change et déséquilibres de balance de paiements

2. Taux de change et impact de la politique monétaire

1. Poids du taux de change dans la politique monétaire
2. Réaction du taux de change aux décisions de politique monétaire
3. Politique de communication et taux de change
4. Taux de change et intervention
5. Taux de change et accumulation de réserves
6. Taux de change, politique monétaire et contrôle des capitaux

3. Régime de taux de change

1. New Exchange Rate Mechanism (ERM II)
2. Nouveaux pays de l'UE et leur taux de change
3. Chine et son taux de change
4. Régime de taux de change des pays asiatiques
5. Fluctuations relatives des grandes monnaies (\$, €, ¥, £, ¥,)

Les travaux qui seront sélectionnés pour la conférence ont aussi en commun d'être abordés avec la volonté de tester des hypothèses de comportements économique sur des données (**metron**); les outils scientifiques mis en œuvre peuvent relever de l'analyse de données, du traitement de séries chronologiques (modèles AR), de la modélisation globale ou sectorielle, voire de la théorie des jeux en fin de compte de l'économétrie (au sens large du terme).

Vous souhaitez présenter une communication sur l'un de ces thèmes :

- 1- de préférence à partir du site www.aea.fed-eco.org/2005Lux/FR/appel.asp remplissez le questionnaire en ligne (il faudra joindre au moins le résumé de votre article) **avant le 15/12/2004**.
- 2- Vous pouvez aussi retourner votre proposition à AEA 53 rue Saint Denis 75001 Paris F

Les auteurs seront, après examen de leurs travaux par le comité scientifique, prévenus **avant le 01/02/2005**.