

Econométrie des séries temporelles / données haute fréquence

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 30,0
- > Période de l'année : Enseignement septième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral et Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique

Présentation

Le cours s'articule autour des thèmes suivants (avec simulations et illustrations, par exemple sous R):

- Introduction aux spécificités de l'analyse des séries temporelles
- Processus ARMA
- Processus à racine unitaire et à trend déterministe
- Densité Spectrale et détection de saisonnalité
- Processus auto-régressif stationnaires (VAR)

Objectifs

Savoir modéliser et construire des prévisions sur l'espérance conditionnelle d'une variable économique stationnaire ou intégrée

Évaluation

Contrôle continu comprenant, d'une part, la restitution d'un travail sur projet par rapport écrit et, d'autre part, une soutenance orale.

Prise en compte de la situation sanitaire : se référer à la disposition générale figurant en préambule des fiches de cours du présent document