

Dynamique économétrique (projet tuteuré)

Infos pratiques

- > ECTS : 3,0
- > Nombre d'heures : 21,0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +5
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > Code ELP : 5EgECDYE
- > En savoir plus : Site du master EIPMC <http://master.eipmc.free.fr/>

Présentation

Ce cours d'économétrie est spécifiquement orienté sur les outils économétriques des séries temporelles. Des cas pratiques sont également développés dans chaque chapitre pour documenter l'importance de ces outils dans un cadre empirique.

PLAN DE COURS :

Chapitre 1 : Les séries temporelles non-stationnaires

Chapitre 2 : La théorie de la cointégration

Chapitre 3 : VAR structurels et analyse des réponses impulsionnelles

Chapitre 4 : Introduction à la méthode des projections locales

Chapitre 5 : Introduction à la non-causalité

Objectifs

Ce cours a pour objectif d'apporter aux étudiants des connaissances avancées concernant la modélisation des séries temporelles et l'identification des chocs économiques. En parallèle des concepts théoriques

développés dans le cours, des applications sont proposées sous afin de confronter les étudiants à des cas pratiques.

Évaluation

SESSION 1 :

Contrôle Terminal

• Type : Dossier

Régime Dérogatoire

• Type : Dossier

SESSION 2 :

• Type : Dossier

Utilisation de l'intelligence artificielle :

Dans le cadre de cet EC, l'usage de l'IA pour aider à la réalisation des travaux soumis à évaluation est autorisé pour les tâches suivantes :

*** recherche d'idées

*** édition (correction de fautes d'orthographe et de syntaxe, mise en forme des références, traduction de citations et d'extraits).

*** code

Il est interdit pour les tâches suivantes :

*** construction (problématisation, suggestion de plan)

*** rédaction (amélioration du style, réécriture de passages, rédaction de résumés)

Les résultats fournis par l'IA doivent constituer un matériau pour votre réflexion, et toujours faire l'objet d'une réappropriation et d'une reprise critique.

Tous les usages doivent être documentés dans une section dédiée à la fin de votre travail. Cette section doit permettre à votre lecteur d'évaluer la manière dont vous avez travaillé avec l'IA et mobilisé cette ressource au service d'un travail personnel.

L'intégration directe de contenus engendrés par l'IA doit être faite sous le régime de la citation.

Pré-requis nécessaires

Le cours exige un niveau M1 en probabilités, statistiques, économétrie des séries temporelles.

Compétences visées

- Maîtriser les fondamentaux en modélisation des séries non-stationnaires,
- estimation par maximum de vraisemblance,
- identification des chocs structurels.

Bibliographie

- Franses, P., Dijk D. (2008). Non-linear time series models in empirical finance. Cambridge University Press.
- Hamilton, J. (1994). Time Series Analysis. Princeton University Press.
- Lütkepohl, H. (2005). New introduction to multiple time series analysis. Springer Science & Business Media.
- Kilian, L. and Lütkepohl, H. (2017). Structural Vector Autoregressive Analysis. Cambridge University Press.
- Jordà (2026). <https://sites.google.com/site/oscarjorda/home/local-projections>

Ressources pédagogiques

Classe interactive

Contact(s)

> Thomas Chuffart

Responsable pédagogique
tchuffart@parisnanterre.fr