

# 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*