Master Économie
Séries temporelles multivariées et non linéaires

Responsable	Descriptions	Informations
	Code : BECDV17C	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion
	Nature :	Nombre de crédits :
	Domaines : Droit, Économie, Gestion	

Dernière modification le 30/06/2023

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

CONTENU

Familiariser l'étudiant avec l'analyse multivariée et non-linéaire

Plan du cours détaillé :

- Introduction aux séries temporelles
- Modèles non-linéaires (TAR, STAR, MS, tests, prévisions)
- Modèles multivariés (VAR, SVAR, cointégration)
- Modèles factoriels (Macro, fondamentaux, ACP)
- Modèles de volatilité multivariés (VEC, BEKK, DCC, OGARCH)

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Maîtrise des outils descriptifs d'analyse des séries temporelles
- Connaissance des modèles non-linéaires et multivariés
- Maîtrise des outils diagnostics
- Compréhension des forces et faiblesses des modèles en termes de prévision

MODALITÉS D'ORGANISATION

- 8 séances de 3 heures alternant exposés théoriques et pratique
- Applications sur R et Oxmetrics
- Lecture préparatoire des étudiants avant chaque session

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

- Tsay, R. S., Analysis of Financial Time Series, Wiley, ed. 3, 2010.
  Autres références:
- Hamilton, J., Time Series Analysis, Princeton University Press,1994
- Diebold, F. X., Time Series econometrics, online on author's webpage, 2017

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

- Statistiques
- Introduction à l'économétrie

PRÉREQUIS RECOMMANDÉS

Econométrie des séries temporelles

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures
- Cours magistraux: 24 heures

CODES APOGÉE

- BECD17C [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS

Aller sur le site de l'offre de formation...