

Econométrie des séries temporelles

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours donne un aperçu des techniques de modélisation de séries temporelles en économétrie. Les sujets abordés incluent les processus stationnaires et non stationnaires, la modélisation et la prévision univariées avec les modèles ARMA, et la modélisation multivariée avec les modèles VAR et VECM. Les applications empiriques du cours sont principalement tirées de la macroéconomie et de la finance et sont mises en œuvre à l'aide du logiciel GRET.

Compétence à acquérir :

Analyse univariée et multivariée des séries temporelles. Utilisation du logiciel GRET.

Mode de contrôle des connaissances :

- Examen écrit.
- Projet sur GRET

Bibliographie, lectures recommandées :

- Bourbonnais R., Econométrie : cours et exercices corrigés, Dunod, 9ème édition., 2015.
- Brooks C., Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University Press, 3ème édition, juin 2014.
- Ghysels E. et Marcellino M., Applied Economic Forecasting using Time Series Methods, Oxford University Press, 2018.

Document susceptible de mise à jour - 07/02/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16