Econométrie des séries temporelles

ECTS : 3

Enseignant responsable : Marie BESSEC (https://dauphine.psl.eu/recherche/cvtheque/bessec-marie)

Langue du cours : Français

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Chapitre 1 - Processus ARMA stationnaires Chapitre 2- Processus ARIMA non stationnaires Chapitre 3- Identification, estimation et prévision d'un processus ARMA Chapitre 4- Processus VAR Chapitre 5- Cointégration et modèles à correction d'erreur

Compétences à acquérir :

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

Pré-requis obligatoires

Cours de statistique et cours d'économétrie de niveau L3

Mode de contrôle des connaissances :

- Examen écrit.
- Projet nécessitant GRETL

Coefficient : 2.00

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 - 04/11/2026

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