

Syllabus

Behavioral and Digital Economics for Effective Management (BDEEM)

Course title	Econométrie des Séries Temporelles (cours en français, optionnel)
Teacher	Jean-Baptiste Bonnier
shared course	No <input type="checkbox"/> Yes <input checked="" type="checkbox"/>
Hourly volume	24
Evaluation methods	Devoir sur table + dossier
Course summary	<p>En économie, on est souvent confronté à des variables qui évoluent dans le temps, comme le PIB ou le prix du pétrole, par exemple. Ces variables peuvent être considérées comme la réalisation d'une séquence de variables aléatoires, variables aléatoires qui peuvent entretenir une relation de dépendance. On appellera cette séquence une série temporelle. Les séries temporelles font l'objet d'un traitement particulier en économétrie. C'est l'objet de ce cours. Il s'articule autour de la procédure de Box et Jenkins. Cela permet de faire intervenir des notions centrales en séries temporelles sur lesquelles on insistera tout particulièrement (stationnarité, tests de racine unitaire, processus ARMA, etc).</p>
Skills	Etre capable d'utiliser certains concepts centraux : stationnarité, tests de racine unitaire, processus ARMA, etc. Mettre en pratique avec R.

