

MASTER ECONOMIE APPLIQUÉE

AGRICULTURE, MER, ENVIRONNEMENT

Semestre 8

TECHNIQUES QUANTITATIVES

Econométrie des séries temporelles

Présentation

Après un rappel du modèle de régression linéaire, le cours présente les outils utilisés en économétrie des séries temporelles, branche de l'économétrie dont l'objet est l'étude des variables aux cours du temps. Beaucoup de variables caractérisées par un trend ne sont pas stationnaires. Ce module a pour objectif d'introduire les problèmes induits par la non stationnarité des séries. Il présente les modèles de séries temporelles univariés, les tests de stationnarité et le concept de cointégration et enfin les modèles multivariés.

2 crédits ECTS

Volume horaire

Travaux Dirigés : 12h

Cours Magistral : 12h

Modalités de contrôle des connaissances

Session 1 ou session unique - Contrôle de connaissances

Nature de l'enseignement	Modalité	Nature	Durée (min.)	Coefficient	Remarques
	CT	Ecrit - devoir surveillé	60	100%	

Session 2 : Contrôle de connaissances

Nature de l'enseignement	Modalité	Nature	Durée (min.)	Coefficient	Remarques
	CT	Ecrit - devoir surveillé	60	100%	