Nom du Syllabus :	Séries Temporelles
Niveau :	M2
Année :	2
Trimestre :	1
Enseignant (e):	Liliane Bonnal

OBJECTIFS :

Modéliser des séries temporelles, macroéconomiques, ou financières et faire des prévisions.

PLAN DU COURS :

Chapitre 0 : Introduction et ressources complémentaires en R et SAS

Chapitre 1 : Explorations et notions générales sur les séries temporelles

Chapitre 2 : Les modèles ARMA et SARMA

Chapitre 3 : Processus non stationnaires : tests de racine unité

Chapitre 4 : Modèles VAR et VARMA.

PRE-REQUIS :

Econométrie des modèles linéaires

Théories des tests.

BIBLIOGRAPHIE :

Séries Temporelles avec R, Y. Aragon, Springer édition

Econométrie, Greene, Pearson édition

Econometric analysis of cross section and panel data, Wooldridge, MIT Press