

Econométrie des Séries Temporelles et des Données de Panels

CHAPELLE Karine
Maître de conférences

Présentation de la matière :

Cour hybride*

Présentiel : CM 32h _TD_16h :

Après un approfondissement de certaines notions acquises en Licence 3, ce cours traitera essentiellement des techniques d'analyse des séries temporelles préalables à toute estimation sur données longitudinales.

Bien que technique et mathématique, l'analyse des séries temporelles trouve des applications en économie notamment en macroéconomie, en Gestion et Finance.

A distance en complément (et non en substitution) du présentiel :

Une partie du cours en présentiel est complété par des activités et des ressources pédagogiques présentes sur l'espace de cours Universitice.

Il est donc **impératif** que votre inscription soit à jour (cf. infra) et que les sections du chapitre soient étudiées avant les séances de CM et de TD de la semaine.

Prérequis impératifs

- Statistiques
- Inférences Statistiques
- Econométrie (Niveau Licence 3)

Plan du cours

Chapitre 1:

La démarche économétrique

Chapitre 2:

La modélisation économétrique

Chapitre 3:

Les données

Chapitre 4:

Rappels sur la méthode des moindres carrés ordinaires

Chapitre 5:

Analyse de la saisonnalité d'une variable

Chapitre 6 :

Analyse de la stationnarité des variables

Ressources pédagogiques sur le site Universitice :

Econométrie des Séries Temporelles et de Panel -M1-GTLD-EGRF



Inscription automatique à l'espace de ce cours sur le site Universitice pour tout étudiant ayant finalisé son inscription universitaire.

- Ressources « Livre » de chaque chapitre ;
- Libre Office Impress des chapitres et des séances de TD ;
- Enoncés des Séances de TD et leurs corrections ;
- Données pour les séances de TD ;
- Logiciels utilisés ;
- Exercices d'autonomie et Tests d'apprentissage ;
- Enoncés et corrections des examens passés ;
- Références Bibliographiques ;
- Informations diverses :
 - modalités d'examen
 - modalités du cours...

ATTENTION:

Il est important que l'étudiant effectue les démarches d'inscription le plus tôt possible. En effet, sans inscription administrative valide, l'accès aux ressources pédagogiques ne sera pas possible. Aucun document ne sera distribué en cours ou en TD! Les devoirs seront également à déposer sur l'espace de cours sur Universitice.

Modalités de contrôle des connaissances

Statut_Etudiant:

- Contrôle(s) Continu(s) :

Pondération: 50%; Nature: Ecrit ;
Nombre: au moins 1 Session : 1
Durée: équivalent 1h30 maximum

- Contrôle Terminal:

Pondération: 50%; Nature: Ecrit
Nombre: 1 Session: 1
Durée: 1h30 maximum

- Contrôle Rattrapage

Pondération: 100% Nature: Ecrit
Nombre: 1 Session: 2
Durée: 1h30 maximum

cette note remplace la moyenne de la 1^{ère} session (CT+CC)

Statut_Etudiant-Salarié:

- Pas de Contrôle Continu

- Contrôle Terminal:

Pondération: 100%; Nature: Ecrit
Nombre: 1 Session: 1
Durée: 1h30 maximum

- Contrôle Rattrapage

Pondération: 100% Nature: Ecrit
Nombre: 1 Session: 2
Durée: 1h30 maximum

cette note remplace la note du CT de la 1^{ère} session.