

Séries temporelles

Introduction

Vincent Bouvatier

Université de Paris Ouest - Nanterre La Défense
Bâtiment G, bureau 308A
vbouvatier@u-paris10.fr

Plan du cours

- 1 Chapitre introductif : Travail préliminaire sur les données
- 2 Modèles ARCH et GARCH
- 3 Modèles de régressions non-linéaires
- 4 Modèles VAR

- Programme du TD
 - Applications basées sur les chapitres du cours
 - Utilisation du logiciel SAS

- Slides et documents de TD disponibles sur :
<http://coursenligne.u-paris10.fr/>
- Références en début de chaque chapitre
 - manuels d'économétrie
 - articles

- Examen première session
 - questions de cours
 - interprétations à partir de sorties
- Examen seconde session : même format que la première session