

Séries temporelles et analyses économiques

Course title - Intitulé du cours	Séries temporelles et analyses économiques
Level / Semester - Niveau /semestre	M2 / S1
School – Composante	Ecole d'Economie de Toulouse
Teacher - Enseignant responsable	LAVERGNE PASCAL
Lecture Hours - Volume Horaire CM	30
TA Hours - Volume horaire TD	
TP Hours - Volume horaire TP	
Course Language - Langue du cours	Français
TA and/or TP Language - Langue des TD et/ou TP	Français

Teaching staff contacts - Coordonnées de l'équipe pédagogique :

Mail : pascal.lavergne@ut-capitole.fr Bureau MF 210 Accueil des étudiants: sur rendez-vous

Course's Objectives - Objectifs du cours :

Nous étudierons les principaux concepts et méthodes pour l'analyse économique des séries temporelles. Les techniques de base de modélisation et de prévision univariée et multivariée sont introduites avec des applications avec l'aide de R et packages de séries temporelles.

A la fin du cours, les étudiants doivent savoir analyser des séries temporelles univariées ou multivariées en choisissant les méthodes appropriées et interpréter les résultats empiriques. Ce cours prépare au cours de Macroéconomie et conjoncture du deuxième semestre.

Prerequisites - Pré requis :

- Connaissances en analyse / algèbre (niveau M1)
- Probabilités et statistiques (niveau L3) : en particulier tests d'hypothèses et intervalles de confiance
- Cours d'Econométrie et d'Econométrie Appliquée de M1 ou équivalents
- Connaissance de R et RStudio

Practical information about the sessions - Modalités pratiques de gestion du cours :

Mercredi 14h-17h en salle informatique (à préciser) du 11/09 au 20/11 inclus

Grading system - Modalités d'évaluation :

L'évaluation des étudiants sera basée sur

1. Des devoirs maisons rédigés en groupe
2. Un projet rédigé en groupe
3. Un examen final

Bibliography/references - Bibliographie/références :

Time Series Analysis with Applications in R (2008) by Jonathan D. Cryer and Kung-Sik Chan, Springer.

Applied Time Series Analysis with R, Second Edition (2017) by Wayne A. Woodward, Henry L. Gray, and Alan C. Elliott, CRC Press.

Session planning - Planification des séances :

Sera communiqué ultérieurement aux étudiants.