

Titre	Responsables	Charge Planifiée
Séries temporelles	Christian de Peretti	28h+2h Exam

OBJECTIFS

Série Temporelle

SOMMAIRE

1. Processus univariés stationnaires (ARMA), application en économie et finance générale
 2. Processus multivariés stationnaires (VARMA), application en économie et finance
 3. Processus univariés non-stationnaires (racine unitaire), application en macroéconomie
 4. Processus multivariés non-stationnaires (cointegration), application en économie internationale
- + TD sur ordinateur avec le logiciel Eviews

Bibliographie

- Applied Econometric Time Series, 2nd Edition, Walter Enders (Author), Wiley Series in Probability and Statistics

Options et Masters

Option MD/ Master RISE/ Master SAFIR