

## **Projet de Séries Temporelles** **Magistère d'Economie deuxième année**

Le projet (étude de la série de votre choix) doit être proprement rédigé, tapé, et doit présenter les résultats (SAS) pertinents ainsi que les commentaires des résultats.

Il doit comporter une introduction, présentant le sujet (quelle série vous étudiez et quel est l'intérêt), puis des parties relatives au traitement de la non stationnarité, à la modélisation proprement menée de la partie stationnaire, et aux calculs de prévision pour la série étudiée, et enfin une conclusion sur le travail effectué.

Pour le traitement de la série, il vous est demandé de traiter tous les points suivants :

- Présentation de la série (graphique, autocorrélations)
- Etude de la non stationnarité de la série (sa présence, sa nature à l'aide de la méthode heuristique présentée en cours et des tests de non stationnarité de Dickey et Fuller et de Phillips et Perron)
- Choix d'un (de) modèle(s) ARMA sur la série correctement stationnarisée à l'aide des autocorrélations (simples, partielles et éventuellement inverses) et des critères d'information
- Estimation du (des) modèle(s) ARMA sélectionné(s)
- Tests de validation (absence d'autocorrélation, absence d'hétéroscédasticité, normalité) sur les résidus estimés du (des) modèle(s) ARMA
- Choix du modèle pertinent s'il reste plusieurs modèles possibles à l'aide de prévisions (en échantillon)
- Calcul de prévisions hors échantillon

This document was created with Win2PDF available at <http://www.daneprairie.com>.  
The unregistered version of Win2PDF is for evaluation or non-commercial use only.