Contenus

Code du Cours	Nom du Cours	Semestre du Cours	Cours Théoriques	Travaux Dirigés (TD)	Travaux Pratiques (TP)	Crédit du Cours	ECTS
ECK 563	Series Temporelles	2	3	0	0	3	8

Cours Pré-Requis	
Conditions d'Admission au Cours	

Langue du Cours	Turc
Type de Cours	Électif
Niveau du Cours	Master
Objectif du Cours	Créer le concept de systèmes dynamiques chez les étudiants diplômés. Nous ne pouvons pas montrer que les systèmes dynamiques ont une modélisation différente selon les situations rencontrées
Contenus	Adapter les systèmes dynamiques aux problèmes et aux observations des sciences sociales, enseigner les processus stochastiques et en particulier les processus autorégressifs au besoin, et tester leurs propriétés dynamiques. L'utilisation de ces tests pour étudier la validité de certaines hypothèses de la théorie économique et de la théorie financière, pour discuter des théorèmes et des hypothèses qui ont perdu leur validité et pour fournir l'infrastructure nécessaire à l'étudiant afin de modéliser conformément aux développements actuels.
Ressources	J.D. Analyse des séries chronologiques de Hamilton Économétrie Hayashi, Mishkin Money, banques et systèmes financiers Banarjee et al. Co-intégration Marche non aléatoire de Malkiel Aumann accepte d'être en désaccord Ozkaya, estimation de Karanfil de l'économie non enregistrée

Intitulés des Sujets Théoriques

Semaine	Intitulés des Sujets
1	Systèmes dynamiques - Kalman
2	Filtre Kalman - test de l'offre et de la demande
3	Fama - Malkiel EMH
4	Aumann Agreeing to disagree
5	Geonokoplos-Polermarchakis
6	EUT - von Neumann , J. Nash, SEUT - Savage, Gilboa
7	AR(p), MA(q) Hamilton 3. - 4. Chaptire
8	ADF, PP, KPSS Processus stochastiques
9	Ozkaya, Karanfil Estimation of unrecorded economy
10	Analyse de la volatilité CB et exemple GARCH
11	FOREX, application
12	Once d'or, application des prix du pétrole
13	Linéaire - exemple de processus non stochastique

Semaine	Intitulés des Sujets
14	Analyse de la volatilité CB et exemple GARCH