

Approche type au partiel

(non exhaustive)

Économétrie des séries temporelles

Question de cours

- définition littéraire
- définition formelle

Compréhension

- modélisation univariée
- modélisation multivariée (notamment $\pi = \alpha\beta'$)

Interprétation

- graphiques
- résultats
 - d'estimation
 - tests sur résidus

Calcul d'autocovariances et autocorrélations

Calcul de racines réelles

Exercices type, tel que vu en

- TD
- sur le github
 - KS financial-econometrics-2020-2021-chapter-4.pdf
 - KS financial-econometrics-2020-2021-chapter-5.pdf