

COURS D'ECONOMETRIE DES SERIES TEMPORELLES

INTRODUCTION

L'Econométrie Appliquée concerne les domaines suivants :

I) **La microéconomie** : quantification des décisions des agents économiques :

- ➔ Econométrie de la production et de la demande
- ➔ Microéconométrie du marché du travail
- ➔ Econométrie et théorie des jeux
- ➔ Choix qualitatifs et biais de sélection...

II) **La macroéconomie** : étude dynamique des grandeurs économiques :

- ➔ Evolution temporelle d'une série économique
- ➔ Les modèles VAR
- ➔ La non-stationnarité des séries économiques
- ➔ Les phénomènes de mémoires longues (ARFIMA)
- ➔ Econométrie de la finance...

La notion de « séries temporelles » ne concerne que le domaine II.

Globalement l'économétrie appliquée c'est l'application de certaines méthodes en suivant la trame suivante :

- estimation**
- vérification**
- prévision**
- simulation**

Ce cours est une introduction à la science et à l'art de construire et d'utiliser des modèles.

C'est une science car c'est un ensemble d'éléments, d'instruments utilisé pour construire et tester mathématiquement la représentation du monde réel. Cet ensemble d'instruments dépend des méthodes, des progrès de l'économétrie.

C'est un art car c'est un ensemble de jugements intuitifs. Il n'existe aucune règle précise. La construction d'un modèle se fait par l'intuition, au feeling.....par l'expérience.