







5 crédits	22.5 h + 7.5 h	Q2
-----------	----------------	----

Enseignants	von Sachs Rainer ;
Langue d'enseignement	Anglais
Lieu du cours	Louvain-la-Neuve
Préalables	<i>Le(s) prérequis de cette Unité d'enseignement (UE) sont précisés à la fin de cette fiche, en regard des programmes/formations qui proposent cette UE.</i>
Thèmes abordés	Les principaux thèmes de cette introduction aux séries chronologiques incluent la modélisation, l'estimation et la prédiction de deux types de processus - les processus linéaires et les modèles hétéroscédastiques non-linéaires. L'approche pour les deux modélisations sera essentiellement paramétrique - l'étudiant va apprendre comment quantifier l'incertitude statistique en estimation des paramètres du modèle stochastique pour la série observée dans le problème de l'objectif ultime, la prédiction des valeurs futures de cette série.
Acquis d'apprentissage	<p>A. Eu égard au référentiel AA des programmes de master en statistique, orientation générale et orientation biostatistique, cette activité permet aux étudiants de maîtriser de manière prioritaire les AA : 1.2, 2.2, 2.3, 3.2, 3.3.</p> <p>1 B. Après avoir suivi ce cours, l'étudiant aura acquis une compréhension logique et une maîtrise opérationnelle des modèles stochastiques utilisables pour la prévision quantitative des séries chronologiques. Il sera capable d'appliquer les principes de l'analyse Box-Jenkins et la modélisation (G)ARCH aux données réelles.</p> <p>-----</p> <p><i>La contribution de cette UE au développement et à la maîtrise des compétences et acquis du (des) programme(s) est accessible à la fin de cette fiche, dans la partie « Programmes/formations proposant cette unité d'enseignement (UE) ».</i></p>
Contenu	Contenu - Modélisation des séries chronologiques : introduction - Processus linéaires - modèles paramétriques simples (ARMA) - Estimation et prédiction dans des modèles ARMA - Méthodologie de Box et Jenkins - modèle (S) ARIMA - Processus non-linéaires - modèles hétéroscédastiques (G)ARCH - Application dans le domaine des finances. Méthode Des modèles de base pour des processus linéaires seront discutés dans la première partie du cours. L'analyse des données observées à l'aide de l'estimation des paramètres du modèle ajusté se fera essentiellement avec les méthodes selon Box-Jenkins. Un traitement en pratique sur ordinateur va accompagner le développement théorique. Dans la deuxième partie du cours, on discutera quelques éléments de la modélisation non linéaires du type ARCH et GARCH avec des applications dans le domaine des données financières. Cette partie sera incluse dans l'analyse pratique sur ordinateur (à l'aide du logiciel S-Plus).
Autres infos	Pré-requis Une connaissance générale des concepts de base de la statistique (du niveau d'un premier cours introductif en statistique). Evaluation L'examen se réalise comme une interrogation orale. La réalisation d'un travail pratique sur ordinateur est prévue. Support Syllabus, von Sachs, R. and S. Van Bellegem, script. Ouvrages de référence Brockwell, P. and R. Davis (1996), Introduction to Time Series and Forecasting. Springer, New York Brockwell, P and R. Davis (1991), Time Series, Theory and Methods. Springer, New York Gourieroux, Ch. (1992), Modèles ARCH et applications financières. Economica, Paris
Faculté ou entité en charge:	LSBA

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)				
Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master [120] en sciences actuarielles	ACTU2M	5	LFSAB1105 ET LSTAT2020	
Master [120] en statistique, orientation biostatistiques	BSTA2M	5		
Master [120] en sciences économiques, orientation générale	ECON2M	5		
Master [120] : ingénieur civil biomédical	GBIO2M	5		
Master [120] en statistique, orientation générale	STAT2M	5		
Master [120] : ingénieur civil en mathématiques appliquées	MAP2M	5		
Master [120] en science des données, orientation statistique	DATS2M	5		