

▲ À qui s'adresse la formation ?

À tous les ingénieurs et cadres de tous secteurs d'activité.

▲ Durée
5 jours

▲ Dates & Lieu
13 au 17 octobre 2008
à Rueil-Malmaison

▲ Frais d'inscription
2 020 €

▲ Responsable
Sandra Raki-Rechignac

Réf. EG/ECP

ÉCONOMÉTRIE ET PRÉVISION

OBJECTIFS

Initier à l'utilisation des outils économétriques en vue d'effectuer des recherches de corrélations, des ajustements entre séries physiques ou économiques et de réaliser des prévisions ou simulations.

À l'issue de la formation, les participants seront capables :

- d'utiliser les principaux outils ;
- de réaliser une estimation économétrique ;
- d'effectuer des prévisions, en particulier dans le domaine de l'énergie ;
- de construire des modèles simples d'analyse des marchés financiers.

PROGRAMME

LES BASES

1 jour

Éléments de statistiques.

L'ajustement linéaire.

La méthode des moindres carrés.

MÉTHODES ET APPLICATIONS

2 jours

Détection des défauts d'ajustement et correction :
autocorrélation, hétéroscédasticité, multicollinéarité.

Comment réaliser des prévisions au moyen des équations obtenues :
application à la demande d'énergie.

TRAITEMENT DES SÉRIES TEMPORELLES

1 jour

Décomposition saisonnière, méthodes de lissage.

Modèles autorégressifs et prévisions à court terme.

ANALYSE ÉCONOMÉTRIQUE DU FONCTIONNEMENT DES MARCHÉS

1 jour

Tests de racine unité et de cointégration.

Modélisation des marchés financiers et énergétiques.