

Analyse avancée des séries temporelles avec EViews

Objectifs pédagogiques :

Cette formation avancée d'une journée est construite de manière à couvrir les aspects fondamentaux de l'analyse des séries temporelles avec EViews, en se concentrant sur les modèles univariés et multivariés. Il combine des rappels des concepts théoriques avec des exercices pratiques mis en œuvre avec EViews pour améliorer les compétences des participants en matière de modélisation et de prévisions avancées des séries temporelles.

Le programme peut être adapté sur deux jours dans le cas où les participants souhaitent renforcer leurs compétences dans le domaine des méthodes d'analyse des séries temporelles. Il peut être également être ajusté en fonction des compétences et des besoins des participants et du rythme souhaité d'apprentissage.

Niveau : Intermédiaire

Prérequis :

Une formation en statistiques de bases. Une connaissance préalable des méthodes sur les séries temporelles est préférable pour profiter pleinement de la formation.
Aisance avec les outils informatiques, disposer d'une connexion Internet.

Public cible :

Toute personne (chercheur, chargés d'études, opérationnels, ...) qui souhaite utiliser Eviews pour mettre en œuvre des méthodes d'analyse et de prévision de séries temporelles univariées et multivariées.

Durée : 7 heures

Modalités de formation envisageables

- Inter-entreprise
- Intra-entreprise
- Coaching
- Présentiel
- Distanciel (classe virtuelle)

FRANCE

72, rue des Archives
75003 PARIS
formation@ritme.com
+33 (0)1 42 46 00 42

BELGIQUE

40, rue des Anciens Étangs
1190 BRUXELLES
info@ritme-be.com
+32 (0)2 203 90 48

SUISSE

Voie du Chariot 3
1003 LAUSANNE
info@ritme.ch
+41 (0)21 711 15 20

Programme détaillé de la formation

Session 1 : Rappel des notions de base sur les séries temporelles et mise en œuvre avec EViews (1h30)

1. Introduction à l'analyse des séries temporelles (30mn)
 - a. Définition et importance des séries temporelles
 - b. Application de l'analyse des séries temporelles
2. Interface et configuration EViews (30mn)
 - a. Revue de l'interface
 - b. Mise en place d'un projet d'analyse des séries temporelles
 - c. Chargement et organisation des données
3. Exploration préalable des données (30mn)
 - a. Statistiques descriptives
 - b. Exploration graphique
 - c. Identifier les tendances et les modèles

Session 2 : Analyse de séries temporelles univariées (1h30)

1. Stationnarité et différenciation (30mn)
 - a. Comprendre la notion de stationnarité
 - b. Différencier pour atteindre la stationnarité
 - c. Mise en œuvre dans EViews
2. Modèles ARIMA (1h)
 - a. Introduction aux modèles ARIMA
 - b. Identification des paramètres
 - c. Mise en œuvre dans EViews : construction et interprétation

Session 3 : Analyse de séries temporelles multivariées (2h)

1. Les modèles VAR (1h)
 - a. Introduction
 - b. Estimation avec EViews
 - c. Les fonctions de réponse impulsionnelle : mise en œuvre et lecture des résultats
2. Modèles de cointégration et à correction d'erreurs (ECM) (1h)
 - a. Comprendre la notion de cointégration
 - b. Mise en œuvre et interprétation avec EViews

FRANCE

72, rue des Archives
75003 PARIS
formation@ritme.com
+33 (0)1 42 46 00 42

BELGIQUE

40, rue des Anciens Étangs
1190 BRUXELLES
info@ritme-be.com
+32 (0)2 203 90 48

SUISSE

Voie du Chariot 3
1003 LAUSANNE
info@ritme.ch
+41 (0)21 711 15 20

Session 4 : Prévision et évaluation de modèles (2h)

1. Prévision de séries temporelles (1h)
 - a. Présentation des méthodes de prévision
 - b. Mise en œuvre avec EViews
 - c. Evaluation de la précision des prévisions
2. Evaluations et diagnostic du modèle (30mn)
 - a. Tests de diagnostics
 - b. Interprétation des résultats et examen des résidus du modèle
 - c. Des modèles affinés pour de meilleures prévisions : combinaison de méthodes
3. Exercice pratique (30mn)

Moyens pédagogiques et d'encadrement :

Supports pédagogiques en format numérique, alternance entre théorie et pratique. Etudes de cas concrets. Séances avec le formateur et utilisation des données fournies par les participants (*en cas de formation intra-entreprise et/ou de coaching*). Ressources d'apprentissage additionnelles pour les participants qui souhaitent approfondir des sujets spécifiques.

Dispositif de suivi et d'évaluation des acquis :

Mise en pratique et exercices. Pauses et séances de Questions-Réponses tout au long de la journée pour améliorer l'engagement des participants.

Résultats & compétences attendus à l'issue de la formation :

Maîtrise de base du logiciel pour les méthodes d'analyse et de prévision des séries temporelles univariées et multivariées.

Mis à jour le : 29/12/23

FRANCE

72, rue des Archives
75003 PARIS
formation@ritme.com
+33 (0)1 42 46 00 42

BELGIQUE

40, rue des Anciens Étangs
1190 BRUXELLES
info@ritme-be.com
+32 (0)2 203 90 48

SUISSE

Voie du Chariot 3
1003 LAUSANNE
info@ritme.ch
+41 (0)21 711 15 20