

SYLLABUS

Domaine :finance et comptabilité	Filière : بنوك وتأمينات
Spécialité : بنوك وتأمينات	
Semestre : S1	Année scolaire : 2024/2025

Identification de la matière d'enseignement	
Intitulé : Logiciels statistiques.	برمجيات إحصائية
Unité d'enseignement :	
Nombre de crédits : 01	Coefficient : 01
Volume horaire hebdomadaire total : 1h30	
Cours (nombre d'heures par semaine) : 1H30	
Travaux dirigés (nombre d'heures par semaine) :0	
Travaux pratiques (nombre d'heures par semaine) : 0	

Responsable de la matière d'enseignement	
Nom, Prénom, Grade :	Chaima ahlem karima djellab MCB
Localisation du bureau :	-
Email :	chaima-ahlem-karima.djellab@univ-annaba.dz
Horaire du cours et lieu :	En ligne jeudi de 15.30 à 17h

Description de la matière d'enseignement
Pré-requis :
<ul style="list-style-type: none"> • Connaissances de base dans l'utilisation des outils informatiques. • Les aspects théoriques de l'économétrie et de l'analyse des séries temporelles.
Objectifs de la matière d'enseignement :
<ul style="list-style-type: none"> • Connaître un logiciel d'économétrie. • Comprendre et illustrer les concepts théoriques étudiés en économétrie et dans l'analyse des séries temporelles à travers des applications pratiques et des exercices. • Apprendre à utiliser le logiciel en important des données, réalisant des graphiques et en effectuant des analyses. • Savoir estimer la régression linéaire simple et multiple et interpréter les résultats. • Identifier les tests permettant de mesurer les problèmes de mesure dans les modèles de régression et savoir comment les corriger. • Connaître les concepts fondamentaux liés à l'analyse des séries temporelles.

	Contenu de la matière d'enseignement	
	<ol style="list-style-type: none"> 1. Présentation du logiciel EViews 2. Régression linéaire simple 3. Régression linéaire multiple 4. Autocorrélation des erreurs : tests de détection de l'autocorrélation, traitement du problème d'autocorrélation 5. Colinéarité (ou multicollinéarité) : tests de détection de la colinéarité, traitement du problème de colinéarité 6. Hétéroscédasticité : tests de détection de l'hétéroscédasticité, traitement de l'hétéroscédasticité 7. Tests de hasard (Tests for Randomness) 8. Détection de la composante saisonnière, méthodes de désaisonnalisation 9. Fonction d'autocorrélation (FAC) et fonction d'autocorrélation partielle (FACP) 10. Tests de stabilité 11. Méthodologie Box-Jenkins 	

Modalités d'évaluation

Nature du contrôle	Pondération en %
Examen	Non concerné
Micro – interrogation	35%
Travaux dirigés	Non concerné
Travaux pratiques	35%
Projet personnel	Non concerné
Travaux en groupe	Non concerné
Sorties sur terrains	Non concerné
Assiduité (Présence /Absence)	30%
Total	100%

Références & Bibliographie

Titre de l'ouvrage	Auteur	Editeur et année
1. EViews Guide to Accompany Introductory Econometrics for Finance,	Chris Brooks and Robert Wichmann	(2019) Cambridge University Press(2011). Palgrave Macmillan
2. Applied Econometrics .	Dimitrios Asteriou,	Régis Bourbonnais, Michel Terraza.
3. Analyse des séries temporelles . Dunod, Paris	Stephen G. Hall.	(2010).

Planning du déroulement du cours (prévisionnel)

Sem.	Titre du cours	Date
1	Prise de contact et présentation du cours / Présentation du logiciel EViews	03/10/2024
2	Introduction à la régression linéaire simple	03/10/2024
3	Régression linéaire multiple	10/10/2024
4	Autocorrélation des erreurs – Détection et traitement de l'autocorrélation	17/10/2024
5	Colinéarité (ou multicolinéarité) – Tests de détection et solutions	24/10/2024
6	Hétéroscédasticité – Tests de détection et traitement	31/10/2024
7	<i>Tests de hasard</i> – Vérification de la randomisation des données	07/11/2024
8	Détection de la composante saisonnière	14/11/2024
9	Méthodes de désaisonnalisation	21/11/2024
10	Fonction d'autocorrélation (FAC)	28/11/2024
11	Fonction d'autocorrélation partielle (FACP)	05/12/2024
12	Tests de stabilité – Vérification de la stabilité des modèles	12/12/2024
13	Introduction à la méthodologie Box-Jenkins	19/12/2024
14	Micro-interrogation finale	09/01/2025

ANNEXE

N°	Nom	Prénom	Emargement
1			
2			
3			
4			
5			
6			
7			
8			
9			
10			
11			
12			
13			
14			
15			
16			
17			
18			
19			
20			
21			
22			
23			
24			
25			