

Université Abderrahmane MIRA de Bejaïa
Faculté des Sciences Economique, Commerciales et des Sciences de Gestion
Département de Finance et Comptabilité
TP Module Économétrie Financière
Série de TP N°1 – Méthode Box-Jenkins

Questions :

- 1- Quelle est la différence entre une non-stationnarité de type TS et DS ?

Exercice Appliqué sur ordinateur :

Nous vous présentons une Série de données chronologiques de l'indice boursier du CAC 40.

- 1- Importez les données de la série sur Excel vers EViews.
- 2- Représentez la série de données graphiquement sur EViews et commentez le graphique.
- 3- A travers l'analyse graphique, la série est-elle stationnaire, si elle ne l'est pas quel type de non-stationnarité vous présumez ?
- 4- Elaborez le Test de Dickey-Fuller Augmenté sur EViews en suivant le schéma du test.
- 5- Commentez les résultats du Test ADF, quel est modèle de Dickey-Fuller approprié.
- 6- La série est-elle caractérisée par un TS ou DS ?
- 7- La série est-elle stationnaire en niveau ou en différence ? Si en différence, estimez la série différenciée.
- 8- A travers la série de donnée stationnaire, consultez le corrélogramme.
 - Après observation du corrélogramme, quel est le degré p et q du ARMA (p, q) optimal, en sachant que le max de retards qu'on prend en compte est 3 (max = 3 retards).
- 9- En ayant déterminé votre ARMA (p, q) optimal, quel model retiendrez-vous en sachant qu'il devrait etre significatif, et qu'il devrait minimiser les critères d'information AIC, SCH, HQ?
- 10- Les coefficients de votre modèle sont-ils significatifs ?
- 11- Votre Modèle est-il globalement significatif ?
- 12- Les erreurs de votre modèle sont-ils Homoscédastiques ou Hétéroscédastiques ?
- 13- Les erreurs de votre modèle sont-ils autocorrélés ou non ?
- 14- Les erreurs de votre modèle suivent-ils une loi normale ?
- 15- En prenant en compte les questions : 10, 11, 12, 13, 14. Peut-on utiliser votre modèle à des fins de prévisions ?