



Une histoire des concepts des séries temporelles

Véronique Meuriot

Dédiée à la science économique, l'économétrie des séries temporelles (discipline à la frontière entre les sciences humaines et les sciences exactes) n'a cessé de s'enrichir d'outils mathématiques de plus en plus sophistiqués. Les praticiens sont confrontés à une nébuleuse méthodologique dont l'évolution est rythmée par les concepts économiques aussi bien que par les concepts mathématiques. Cette dichotomie opacifie la compréhension de la discipline.

Cet ouvrage propose un éclairage historique sur les développements des concepts des séries temporelles, depuis la naissance de la Société d'Économétrie en 1930 jusqu'à nos jours. Ce texte est composée d'histoires de vie entre les maîtres de la discipline – Granger, Engle, Sims ... – ainsi que de l'exploration des textes fondateurs dans leur contenu et dans leur forme. De cette perspective historique résulte alors un décryptage des concepts mathématiques rendant accessible au plus grand nombre les concepts des séries temporelles.

Véronique Meuriot est économiste, spécialisée en économétrie des séries temporelles. Elle est chercheur au CIRAD, membre de l'unité mixte de recherche ARTDev (UMR 5281). Depuis de nombreuses années, ses travaux portent sur l'analyse de la volatilité et des mécanismes de transmission des prix. Plus récemment, elle s'est orientée vers l'histoire de l'économétrie des séries temporelles.

Prix : 27 € - 29 € hors France
ISBN : 978-2-8061-0060-3



www.editions-academia.be

a

academia
L'Harmattan

Une histoire des concepts
des séries temporelles

Véronique Meuriot

INTELLECTUAL

INTELLECTUAL

INTELLECTUAL