

Master Économie

Econométrie de la banque et de la finance

Responsable	Descriptions	Informations
Sullivan HUE sullivan.HUE@univ-amu.fr	Code : BECCV27B Nature : Élément constitutif Domaines : Droit, Économie, Gestion	Composante : Faculté d'Économie et de Gestion

LANGUE(S) D'ENSEIGNEMENT

Anglais

[Aller sur le site de l'offre de formation...](#)

CONTENU

Ce cours présente les méthodes économétriques utilisées pour mesurer et prédire les risques financiers. Différents modèles seront étudiés. Ces modèles permettent de modéliser au mieux la dynamique des prix (ou rendements), c.-à-d. la moyenne conditionnelle, la variance conditionnelle mais aussi les moments supérieurs (asymétrie, épaisseur des queues de distribution). Une partie de ce cours traitera également de la dépendance entre les rendements de plusieurs actifs.

Plan du cours détaillé :

- Moyenne conditionnelle
- Variance conditionnelle
- Estimation
- Tests de spécification
- Prévision
- Valeur au risque
- Modèles multivariés

COMPÉTENCES À ACQUÉRIR

- Compréhension des modèles de séries temporelles spécifiques aux données financières de marché
- Application à des données réelles
- Prévision du risque
- Utilisation d'outils économétriques spécifiques (OxMetrics) et programmation (R, matlab, python, ox, etc)

MODALITÉS D'ORGANISATION

Lecture.

BIBLIOGRAPHIE, LECTURES RECOMMANDÉES

Laurent S. (2018). G@RCH 8, Estimating and Forecasting ARCH Models, London: Timberlake Consultants Press.

PRÉ-REQUIS OBLIGATOIRES

- Statistiques avancées
- Introduction à l'économétrie
- Maximum de vraisemblance
- Econométrie des séries temporelles

PRÉREQUIS RECOMMANDÉS

Programmation (R, matlab, python, ox, etc)

VOLUME HORAIRE

- Volume total: 24 heures
- Cours magistraux: 24 heures

CODES APOGÉE

- BECC29B [ELP]

M3C

Aucune donnée M3C trouvée

POUR PLUS D'INFORMATIONS



Dernière modification le 30/06/2023