UNIVERSITÉ SAVOIE MONT BLANC

Prévision financière

ECTS
3 crédits

Composante
IAE Savoie Mont Blanc

En bref

- **Langues d'enseignement:** Français
- **Ouvert aux étudiants en échange:** Oui

Présentation

Description

Ce cours a pour objectif d'étudier les modèles statistiquespermettant de prévoir l'évolution des cours des actifsfinanciers et leur volatilité. Il s'agit donc d'une introduction àla maîtrise des outils d'économétrie financière.
Une approche d'économétrie appliquée est privilégiéepuisque l'étude théorique de chaque modèle économétriqueest accompagnée de la présentation d'un exemple surdonnées financières réelles. En outre, les travaux dirigésassociés au cours permettent de poursuivre l'apprentissagedu logiciel STATA en proposant des applications concrètesdes modèles économétriques étudiés.

Heures d'enseignement

CM	Cours Magistral	12h
TD	Travaux Dirigés	12h

Pré-requis obligatoires

Statistiques et techniques de prévision (L3)
Finance (M1 – S7)

Plan du cours

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 14 décembre 2023

MINISTÈRE DE L'ENSEIGNEMENT SUPÉRIEUR, DE LA RECHERCHE ET DE L'INNOVATION
Liberté
Égalité
Fraternité

Introduction
Chapitre 1 : Un gestionnaire de portefeuille est-il utile ?
Chapitre 2 : Le pair trading : les cours de deux actions sont-ils liés ?
Chapitre 3 : La Value at Risk : peut-on minimiser le risque enfinance ?

Compétences visées

* Savoir estimer la rentabilité d'un portefeuille

* Savoir mener un pair trading

* Savoir estimer le risque associé à un portefeuille

Bibliographie

S. Bazen et M. Sabatier, 2007, Econométrie, Vuibert,Chapitre 5.
E. Berndt, 1991, # The Practice of Econometrics : Classicand Contemporary, Addison Wesley.
C. Brooks, 2002, # Introductory Econometrics for Finance,Cambridge University Press.
W. Greene, 2002, Econometric Analysis, Prentice Hall, 5èmeEdition.
M. Verbeek, 2000, A Guide to Modern Econometrics, Wiley.

Infos pratiques

Lieux

- Annecy-le-Vieux (74)

Campus

- Annecy / campus d'Annecy-le-Vieux

Informations non contractuelles.
Dernière mise à jour le 14 décembre 2023

MINISTÈRE DE L'ENSEIGNEMENT SUPÉRIEUR, DE LA RECHERCHE ET DE L'INNOVATION
Liberté
Égalité
Fraternité