

# Prévision financière (ECON802\_EBAAY)

 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 statistiques permettant de prévoir l'évolution des cours des actifs financiers et leur volatilité. Il s'agit donc d'une introduction à la maîtrise des outils d'économétrie financière.

Une approche d'économétrie appliquée est privilégiée puisque l'étude théorique de chaque modèle économétrique est accompagnée de la présentation d'un exemple sur données financières réelles. En outre, les travaux dirigés associés au cours permettent de poursuivre l'apprentissage du logiciel STATA en proposant des applications concrètes des 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

## 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 en finance ?

---

## 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.

---

## Compétences acquises

Macro-compétence	Micro-compétences
------------------	-------------------

---

## Infos pratiques

---

### Contacts

#### Responsable du cours

Jeremy Tanguy

📞 +33 4 50 09 24 53

✉️ Jeremy.Tanguy@univ-savoie.fr

---

### Lieux

➤ Annecy-le-Vieux (74)

---

## Campus

› Annecy / campus d'Annecy-le-Vieux