

Prévision financière (ECON802_EBAAY)



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 : Classic and Contemporary, Addison Wesley.

C. Brooks, 2002, # Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University Press.

W. Greene, 2002, Econometric Analysis, Prentice Hall, 5ème Edition.

M. Verbeek, 2000, A Guide to Modern Econometrics, Wiley.

Libellé court : ECON802_EBAAY

Nature : EC

Infos pratiques

Lieux

➤ Annecy-le-Vieux (74)

Campus

➤ Annecy / campus d'Annecy-le-Vieux

Contacts

Responsable du cours

Jeremy Tanguy

☎ +33 4 50 09 24 53

✉ Jeremy.Tanguy@univ-savoie.fr