Contenus

Code du Cours	Nom du Cours	Semestre du Cours	Cours Théoriques	Travaux Dirigés (TD)	Travaux Pratiques (TP)	Crédit du Cours	ECTS
EC 506	Économétrie financière	2	3	0	0	3	6

Cours Pré-Requis	
Conditions d'Admission au Cours	

Langue du Cours	Turc
Type de Cours	Électif
Niveau du Cours	Master
Objectif du Cours	Utiliser les différentes méthodes économétriques dans le domaine financier et faire des modélisations finanicères.
Contenus	MCO, Analyse de séries temporelles Changement de structure Modèles ARCH-GARCH
Ressources	Wooldrige, "Introduction to econom terics"

Intitulés des Sujets Théoriques

Semaine	Intitulés des Sujets
1	Introduction à l'économétrie de la finance
2	Méthode de MCO dans des modèles linéaires
3	Théorème de Gauss-Markov et tests des hypothèses: test de suites, tests d'autocorrélation, test d'égalité de variances
4	Tests des hypothèses (suite)
5	Application STATA
6	Analyse des séries temporelles: analyse de corrélogramme, tests de racine unitaire
7	Application STATA
8	Présentation des étudiants
9	Présentation des étudiants
10	Changement de structure: modélisation avec des variables muettes
11	Changement de structure: test de Chow, Tests de Cusum et de Cusum-Square
12	Application STATA
13	Modèles ARCH-GARCH
14	Application STATA