Contenus

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	Obligatoire
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 economterics"

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	