Finance Empirique

ECTS : 6

Description du contenu de l'enseignement :

Le cours consiste en une introduction formalisée et pratique aux méthodes statistiques et techniques économétriques utilisées en gestion de portefeuille, trading, pricing de produits dérivés, et gestion des risques. Les différentes parties du cours sont : 1. Définition des rendements d'un actif, Séries temporelles, Efficience des marchés 2. Econométrie de la frontière efficiente, Construction de portefeuilles 3. Modèle d'évaluation d'actifs (CAPM) 4. Modèles multifactoriels, Régressions multivariées 5. Econométrie des produits dérivés

Compétence à acquérir :

Econométrie, Modélisation, Finance Empirique, Méthodes Quantitatives

Mode de contrôle des connaissances :

Commentaire d’un article de recherche sur l’utilisation de modélisations quantitatives en Finance

Bibliographie, lectures recommandées :

Campbell, Lo & MacKinlay (1997). The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press. Gourieroux, Scaillet, Safarz (1997). Économétrie de la Finance, Economica (In French). Aï¨t-Sahalia, Hansen (2010). Handbook of Financial Econometrics, North-Holland.

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16