Econométrie financière

ECTS : 3

Description du contenu de l'enseignement :

Introduction générale :

- Faits stylisés sur les séries financières
- Prévision des rendements et efficience des marchés financiers

Chapitre 1 : modèles de volatilité univariés

- Détection et tests d'un effet ARCH
- Modèles de volatilité univairiés : modèles GARCH, GJR et EGARCH
- Lois conditionnelles non gaussiennes

Chapitre 2 : modèles de volatilité multivariés

- Estimation de la matrice de variance covariance par les méthodes de lissage
- Modèles économétriques de la matrice de variance covariance conditionnelle : BEKK, CCC et DCC

Une partie du cours a lieu en salle de classe et en salle informatique (langages utilisés : gretl ou matlab)

Compétence à acquérir :

Connaissance des principales méthodes économétriques appliquées à la modélisation financière

Mode de contrôle des connaissances :

Examen final en salle informatique

Bibliographie, lectures recommandées :

Alexander, C., Market Risk Analysis: Practical Financial Econometrics?, Editions Wiley, 2008. Brooks, C., Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University Press, 3ème édition, 2014. Bauwens L., Hafner C. et S. Laurent, Handbook of Volatility Models and their Applications, John Wiley \& Sons, 2012.

Document susceptible de mise à jour - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16