

IMFL – UE2 «Analyse Financière»

UE2-3. Econométrie Financière

Objectifs pédagogiques du cours :

L'objectif du cours est de présenter les principes de l'économétrie permettant aux étudiants d'acquérir des techniques qu'ils pourront utiliser en finance. La mise en œuvre des applications se fait avec un logiciel d'économétrie.

- Introduction
- Régressions simple et multiple, tests associés
- Sélection de variables dans un modèle de régression
- Utilisation d'un logiciel d'économétrie

Pré-requis :

- Cours de probabilités et statistique du niveau Licence.

Programme détaillé :

- Introduction à l'économétrie.
- Régressions simple et multiple et tests statistiques associés.
- Sélection de variables dans un modèle de régression.
- Applications en utilisant un logiciel d'économétrie.

Bibliographie :

- Econométrie, W. Green, 5ème édition, Editions Pearson, 2005