

DESCRIPTION DU COURS

ECONOMETRIE APPLIQUE A LA FINANCE

L'économétrie désigne un ensemble de méthodes statistiques et mathématiques dont l'objectif est de quantifier les phénomènes économiques. Elle est pour ses utilisateurs un outil précieux d'analyse et d'aide à la décision. Ce cours propose une formation à la pratique de l'économétrie. Il comprend à la fois un rappel de cours clair et pédagogique sur les méthodes économétriques (de base et avancées), et des applications sur des thèmes économiques diversifiés correspondant à des préoccupations actuelles. Il s'agit de montrer comment, de manière pratique, les différentes méthodes économétriques sont mises en œuvre. L'accent est mis sur la construction de modèles, à partir de fondements microéconomiques ou macroéconomiques et leur évaluation empirique. La démarche proposée est la suivante : (1) définition du modèle à estimer, (2) création d'une base de données, (3) application de la méthode d'estimation appropriée, (4) analyse et interprétation des résultats.

Le syllabus est disponible au début de chaque cours