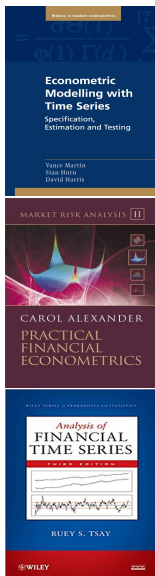


Econométrie Financière Avancée

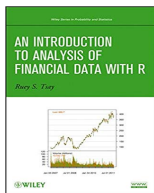
(2023-2024)

Master Économétrie Appliquée (ECAP)

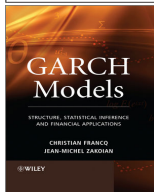
Olivier DARNÉ



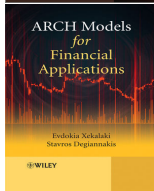
- [Martin, Hurn et Harris](#), *Econometric Modelling with Time Series*, Cambridge.
- [Alexander](#), *Market Risk Analysis (Vol.2) - Practical Financial Econometrics*, Wiley.
- [Tsay](#), *Analysis of Financial Time Series*, Wiley.



- [Tsay](#), *An Introduction to Analysis of Financial Data with R*, Wiley.



- [Francq et Zakoïan](#), *GARCH Models: Structure, Statistical Inference and Financial Applications*, Wiley.



- [Xekalaki et Degiannakis](#), *ARCH Models for Financial Applications*, Wiley.

► Plan du cours

- Chapitre 1 : Propriétés et faits stylisés des séries financières
- Chapitre 2 : Les modèles de volatilité de type GARCH
- Chapitre 3 : La prévision de la volatilité
- Chapitre 4 : La modélisation de la volatilité avec des variables explicatives
- Chapitre 5 : La valeur à risque (VaR)
- Chapitre 6 : ...

► CM (support sur Madoc) + TD sur logiciel

► Evaluation : dossier + QCM