

# ECONOMÉTRIE FINANCIÈRE

---



**Composante**  
Ecole de  
management  
de la  
Sorbonne  
(EMS)



**Volume  
horaire**  
30h



**Période de  
l'année**  
Printemps

## plugin.odf:CONTENT\_PROGRAM\_TAB01\_TITLE

### Description

Cours dispensé par M. Stéphane ROBIN

### Objectifs

Cet enseignement permet une initiation à différentes techniques économétriques applicables en finance d'entreprise et en finance de marché.

### Syllabus

1. Régression linéaire simple et multiple appliquée aux données en coupe transversale, en séries temporelles et de panel, incluant : estimateur des Moindres Carrés Ordinaires (et extensions en panel) ; tests d'inférence usuels ; tests d'hétéroscédasticité et d'auto corrélations des résidus.
2. Modèles de prévision en séries temporelles, incluant : modèles AR, ADL, ARMA et ARIMA ; causalité au sens de Granger ; tests de non-stationnarité (tendance stochastique, rupture); notion de série intégrée; estimateur des Moindres Carrés Généralisés.
3. Notions avancées, incluant : erreurs standards HAC ; modèles VAR et VECM ; co-intégration; modèles à hétéroscédasticité conditionnelle; estimateur du Maximum de Vraisemblance.
4. Modèles à variables dépendantes qualitatives, modèles de comptage en séries temporelles.