

3.00 crédits	15.0 h	Q2
--------------	--------	----



Cette unité d'enseignement n'est pas accessible aux étudiants d'échange !

Enseignants	Gnabo Jean-Yves ;
Langue d'enseignement	Français
Lieu du cours	Bruxelles Saint-Louis
Acquis d'apprentissage	A la fin de cette unité d'enseignement, l'étudiant est capable de : L'objectif du cours est de permettre aux étudiants de consolider leurs connaissances de base en économétrie puis de comprendre et de savoir utiliser quelques méthodes importantes en finance d'analyse empirique. A terme, l'étudiant doit être capable de réaliser un projet d'analyse empirique en finance de manière autonome à l'aide du logiciel Gretl. L'accent est mis sur l'utilisation pratique des outils économétriques.
Modes d'évaluation des acquis des étudiants	Examen en salle machine avec des questions de cours et la réalisation d'une étude de cas nécessitant l'utilisation de Gretl.
Méthodes d'enseignement	Cours magistral et exercices sous Gretl.
Contenu	Plan du cours : 1. Rappel de statistiques et d'économétrie, 2. Méthodes économétriques adaptées aux données financières (séries temporelles, modèles non-linéaires, modèles VAR, modèles de cointégration). Ces modèles sont notamment employés pour l'analyse du risque systémique ou bien encore dans le cadre des modèles de conjoncture (i.e. prévisions macroéconomiques), 3. Analyse du risque d'un actif ou d'un portefeuille par le biais du calcul de Value-at-Risk
Bibliographie	Slides et syllabus du cours.
Faculté ou entité en charge:	ESPB

Programmes / formations proposant cette unité d'enseignement (UE)				
Intitulé du programme	Sigle	Crédits	Prérequis	Acquis d'apprentissage
Master de spécialisation en gestion des risques financiers (horaire décalé)	GRFB2MC	3		