

Dynamique de marchés financiers

Infos pratiques

- > ECTS : 4.5
- > Nombre d'heures : 24.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Niveau d'étude : BAC +5
- > Période de l'année : Enseignement neuvième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Cours magistral
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Campus : Campus de Nanterre
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > Code ELP : 5EgGDMDF

Présentation

Le séminaire porte sur la modélisation des prix d'actifs (actions, taux d'intérêt, taux de change, matières premières). Les étudiants réalisent un mémoire à partir d'un thème choisi parmi différents thèmes proposés ou d'un sujet personnel approuvé par les responsables du séminaire. Quelques thèmes-types sont la volatilité des prix d'actifs, les liens entre ceux-ci et la conjoncture, leur transmission internationale, les primes de risque. Le mémoire inclut une application économétrique personnelle.

Objectifs

A partir de la lecture d'articles de la littérature consacrée à un thème de son choix, ce séminaire vise à solliciter la réflexion de l'étudiant afin de définir sa problématique de recherche, de construire un modèle théorique et de proposer une démarche économétrique permettant d'estimer les paramètres. Cette démarche lui permettra d'apprendre à collecter et manipuler des données statistiques, à maîtriser et appliquer des méthodes économétriques appropriées, à utiliser des logiciels

statistiques, ainsi qu'à interpréter et synthétiser ses résultats. L'étudiant réalisera deux exposés d'une heure, le premier pour présenter l'article étudié et proposer son sujet, le second pour esquisser ses premiers résultats empiriques. Ces interventions seront appréciées au regard des qualités de synthèse mobilisées, de l'assimilation des concepts et des méthodes utilisées, du recul analytique ainsi que de l'expression orale. Elles ont pour finalité d'orienter l'étudiant et de structurer son travail en vue de la réalisation d'un mémoire abouti.

Évaluation

Modalités : CC

SESSION UNIQUE :

Contrôle Continu

• Type : Oral, Dossier

• Durée : --

• Précisions : la note finale combine la qualité du mémoire réalisé et la performance orale évaluée lors de deux exposés effectués au cours de la phase préparatoire du mémoire.

Régime Dérogatoire

• Type : Dossier

• Durée : --

SESSION 2 :

• Type : Dossier

• Durée : --

Utilisation de l'intelligence artificielle :

Dans le cadre de la réalisation des mémoires, l'usage de l'intelligence artificielle (IA) générative

• **est autorisé exclusivement** à des fins d'assistance limitées à la correction orthographique et syntaxique, à la traduction, à la recherche documentaire ainsi qu'à la clarification de points techniques.

• En revanche, le recours à l'IA **est strictement interdit** pour toute activité relevant de la production intellectuelle du mémoire, notamment l'élaboration de l'introduction, la formulation de la problématique, le choix méthodologique, l'analyse et l'interprétation des résultats empiriques, ainsi que la rédaction des conclusions.

Pré-requis nécessaires

- Intérêt pour la modélisation économétrique,
- Compétences en anglais permettant la lecture d'articles publiés dans des revues internationales,
- Connaissances de base en économétrie des séries temporelles,
- Expérience d'un logiciel statistique et de la collecte de données.

Compétences visées

A l'issue de ce séminaire de recherche, l'étudiant doit avoir fait la preuve de sa capacité à mener une analyse économique rigoureuse dans le domaine des marchés financiers (cours boursiers, taux de change, taux d'intérêt, prix des matières premières) alliant approches théoriques et vérifications économétriques, à manipuler des séries statistiques et à maîtriser des logiciels économétriques. Il doit justifier de sa capacité à effectuer des présentations orales claires, concises et avec recul sur un article de la littérature et sur les résultats d'un travail empirique personnel, ainsi qu'à rédiger un mémoire structuré, documenté et informatif.

Bibliographie

Chaque étudiant se verra proposer un ou plusieurs articles de la littérature en fonction du thème choisi pour la réalisation de son mémoire.

Contact(s)

> Remzi Uctum

Responsable pédagogique
r.uctum@parisnanterre.fr