

Projet : Etude d'événements en finance. [Olivier TARAMASCO](#)

L' « étude d'événements » est une des techniques empiriques les plus utilisées dans la recherche en finance. Cela consiste à répondre à une question, en apparence simple : « est-ce que telle décision (financière, économique, politique ...) a un réel impact sur les cours boursiers ? ». L'objet de ce projet est de programmer et tester les méthodes classiques (et moins classiques ?) d'études d'événements. L'objectif est de faire une *package* pour « R » ou un complément Excel.

Outils : statistique, modèles linéaires, optimisation, simulation, R, script R ou MS Visual Studio et Excel.
Equipes : 2 trinômes, 1 pour le *package* R, un pour le complément Excel.