

COLLOQUE ECONOMETRIE DES VALEURS BOURSIERES

Analyse et Prévision

Appel à communications



Colloque International

PARIS

1 et 2 avril 2004

Comité scientifique : Sandrine LARDIC (MODEM, Univ. Paris X) et Valérie MIGNON (THEMA, Univ. Paris X)

Enrique ALBEROLA (Banque d'Espagne), Sanvi AVOUYI-DOVI (Banque de France), Oscar BAJO-RUBIO (Univ. Castilla-La Mancha), Christopher BAUM (Boston College), Meriam BOUSSEMA (Caisses d'Epargne), Catherine BRUNEAU (THEMA, Univ. Paris X), Christophe CHAMLEY (Boston Univ. et DELTA), Yin-Wong CHEUNG (Univ. of California), Richard DALAUD (SGAM), Zsolt DARVAS (Banque Centrale de Hongrie), Gilles DUFRENOT (GREQAM et ERUDITE, Univ. Paris XII), Christian DUNIS (CIBEF et Liverpool Business School), Jeanne FOLLET (AXA-IM), Pierre GIOT (Univ. of Namur et CORE, Univ. of Louvain), Paul de GRAUWE (Univ. of Leuven), Maria-Laura HARTPENCE (SINOPIA AM, HSBC Group), Pavlos KARADELOGLOU (Banque Centrale Européenne), Catherine KYRTSOU (Univ. of Macedonia, Grèce), Eva LILJEBLOM (Swedish School of Economics and Business Administration, Helsinki), Bertrand MAILLET (TEAM, Univ. Paris I, ESCP-EAP et AAA), Auguste MPACKO PRISO (Caisse Nationale des Caisses d'Epargne), Nikolaos PANIGIRTZOGLU (Banque d'Angleterre), Anne PEGUIN-FEISSOLLE (GREQAM), Georges PRAT (MODEM, Univ. Paris X), Hélène RAYMOND-FEINGOLD (CADRE, Univ. Lille II et TEAM, Univ. Paris I), Marie-Chantale RIVIERE (CDC IXIS CM), Henri SERBAT (AEA, Paris), Simon SOSVILLA-RIVERO (FEDEA, Madrid), François SOUPE (Société Générale AM), Julien TAMINE (Société Générale AM), Timo TERÄSVIRTA (Stockholm School of Economics).

L'intégration croissante des marchés financiers et l'introduction de nouvelles technologies de communication ont modifié fondamentalement les relations entre des intervenants toujours plus nombreux. Si l'on ajoute à ces phénomènes la longue période de crise traversée par des marchés actions à peine stabilisés, on détient sans aucun doute des éléments explicatifs de la remise en cause, dans une certaine mesure, des modèles d'évaluation utilisés jusqu'alors. Cette remise en cause a conduit à un renouvellement de la recherche autour de thèmes traditionnels : l'efficacité informationnelle comme organisationnelle des marchés boursiers, la prévision des cours boursiers, la modélisation de la prime de risque des actions, ... A la recherche de nouveaux déterminants des cours boursiers s'est en outre ajoutée une analyse quantitative plus exigeante avec l'utilisation d'outils économétriques plus sophistiqués (modélisations non linéaires, ...). L'objet de ce colloque est de faire un point sur les développements récents de l'économétrie appliquée aux marchés boursiers.

Les thèmes suivants seront privilégiés (liste non exhaustive) :

- Développements récents autour des modèles d'évaluation actions,
- Modélisation de la prime de risque,
- Efficacité informationnelle, études d'événements, anomalies,
- Efficacité organisationnelle,
- Prévisions des cours boursiers,
- Anticipations de bénéfices et cours boursiers, ...

Les propositions de communication (texte intégral, même provisoire) doivent être parvenues **avant le 1 décembre 2003** par mail à : colaea@u-paris10.fr

A défaut, elles pourront être envoyées en trois exemplaires à l'adresse suivante :

Sandrine LARDIC ou Valérie MIGNON, Université Paris X-Nanterre, UFR SEGMI, 200
Avenue de la République, 92001 Nanterre Cedex, France.

Dans un fichier séparé (en format word ou .tex) devront figurer le titre de la communication, un résumé en anglais et en français, les noms et affiliations des auteurs, l'adresse complète ainsi que les numéros de téléphone, fax et adresse électronique de la personne à laquelle sera envoyée toute information.