



1ÈRE JOURNÉE DE STATISTIQUE, ÉCONOMÉTRIE ET FINANCE

- Mercredi 21 Juin 2006 -

*Université de Rouen
Laboratoire de Mathématiques Raphaël Salem (LMRS)
Avenue de l'Université
76801 Saint Etienne du Rouvray*

Organisateur : Antony Gautier (LMRS, Université de Rouen)

Objectifs. La « 1ère Journée de Statistique, Econométrie et Finance » du LMRS cherche à promouvoir les échanges entre statisticiens et économètres, et à valoriser la recherche en statistique et en économétrie appliquées à la finance.

Programme.

10h00 Accueil des participants

10h20 **Guy MELARD** (Université Libre de Bruxelles)
Alternative approaches for autoregressive models with time-dependent coefficients

11h10 **Marc HOFFMANN** (Université de Marne-la-Vallée)
Modèle de reconstruction de signal avec bruit de microstructure

12h00 Déjeuner

13h45 **Leonid GALTCHOUK** (Université Strasbourg 1)
Normalité asymptotique d'un estimateur séquentiel de moindres carrés pour des processus d'autorégression instable

14h35 **Mohammed MRAOUA** (OCP Group, Maroc)
Modélisation stochastique de la température et valorisation des dérivés climatiques

15h25 Pause - Café

15h45 **Jean-Marc BARDET** (Université Paris 1)
Applications en statistiques paramétriques et non-paramétriques de la faible dépendance

16h35 Cocktail

Inscription. L'inscription à la journée et la participation au déjeuner sont gratuites (financement par le LMRS). Pour faciliter l'organisation de la journée, l'inscription est indispensable. Merci de bien vouloir vous inscrire **avant le 14 juin 2006** en envoyant un e-mail à : antony.gautier@univ-rouen.fr.