

SÉMINAIRE QUANTACT

Maciej Augustyniak

Université de Montréal

Économétrie des modèles à changement de régimes

Résumé: Les modèles à changement de régimes (*regime-switching models*, *Markov-switching models*, *hidden Markov models*) sont utiles dans plusieurs domaines : reconnaissance automatique de la parole, analyse statistique de séquences biologiques, modélisation des tremblements de terre et modélisation des données financières. Cet exposé est une introduction pédagogique à ces modèles avec une emphase sur l'application financière. Plus précisément, nous aborderons l'estimation du modèle, la détection des régimes et la validation du modèle. Si le temps le permet, nous verrons également les modèles GARCH à changement de régimes (*regime-switching GARCH models*).

Lundi 17 septembre 2012, 13:30-14:30

PK-5115

Département de mathématiques, UQAM