

## **REFERENCES :**

### **French :**

#### *Econométrie de la Finance :*

Gouriéroux C., Scaillet O., et A. Szafarz (1997), « Econométrie de la finance : Analyses Historiques », Economica, Paris  
[Kernel, CAPM, APT, Logit]

Gouriéroux C (1992), « Modèles ARCH et Applications Financières », Economica, Paris.  
[ARCH, APT, CAPM, CCAPM]

#### *Econométrie et séries temporelles :*

Gouriéroux C., et A. Monfort (1995) « Statistiques et Modèles Econométriques », Vol. I et II, Economica, Paris.  
[Optimisation, OLS, GMM, ML]

Gouriéroux C., et A. Monfort (1995) « Séries Temporelles et Modèles Dynamiques », Economica, Paris.  
[Exp Smoothing, ARMA, Unit root, Cointegration]

Gouriéroux C. (1989) « Econométrie des Variables Qualitatives », Economica, Paris.  
[Logit]

### **English :**

#### *Probability, Statistics & Introductory Econometrics :*

Hsu, H. (1997) « Probability, Random Variables & Random Processes », Schaum's Outlines Series, McGraw Hill.  
[Intro. Probability and Statistics]

Greene, W. « Introductory Econometrics », Prentice Hall.  
[General Econometrics]

Wooldridge, J. « Introductory Econometrics », Thomson.  
[Comprehensive Treatment of Econometrics, including Time Series, Censorship, GMM, etc]

#### *Financial Econometrics :*

Mills T. (1999) « The Econometric Modelling of Financial Time Series », Cambridge University Press, Cambridge.  
[Stoc. Vol., ARFIMA, ARCH]

Campbell J., Lo A. and A. McKinlay (1997) « The Econometrics of Financial Markets », Princeton University Press, Princeton.  
[CAPM, CCAPM, APT, Kernel]

*Econometrics and Time Series :*

Davidson R., and J. MacKinnon (1993) « Estimation and Inference in Econometrics » ,  
Oxford University Press, Oxford.

[Logit, OLS, GMM, ML, ARMA, Unit root, Cointegration, ARCH]

Hamilton J. (1994) « Time Series Analysis » , Princeton University Press, Princeton.

[OLS, Unit root, Cointegration, ARMA]