

Curriculum Vitae détaillé

Situation personnelle

Nom Patronymique : **HURLIN**
Prénom : **Christophe**
Date et lieu de naissance : né le 06 mars 1973 à Montluçon (03)
Adresse personnelle : 4bis Avenue Jean Zay
45 000 Orléans
Téléphone professionnel : 02 38 49 40 47
Laboratoire d'accueil : **LEO**, Laboratoire d'Economie d'Orléans,
Université d'Orléans, UMR CNRS 6221
Page Personnelle :

<http://www.univ-orleans.fr/deg/masters/ESA/CH/churlin.htm>

Expériences professionnelles

Depuis 2002 : Professeur à l'Université d'Orléans

2004 - 2005 : Short Term Consultant, World Bank

2000 - 2002 : Maître de conférences, Université Paris IX Dauphine

2000-2002 : Chercheur associé au CEPREMAP

2000 : Service militaire, Commissariat Administratif de l'Armée de Terre.

1996-1999 : Allocataire moniteur (EUREQUA, Université Paris I Panthéon-Sorbonne)

Titres universitaires

2002 Lauréat du concours d'agrégation de Sciences Economiques

2001 Prix de thèse Gaëtan Pirou de la Chancellerie des Universités de Paris

1996-1999 : Doctorat es Sciences Economiques de l'Université Paris I Panthéon Sorbonne; mention très honorable avec les félicitations du jury, recommandation pour un prix de thèse et une subvention de publication.

Thèse : *"La Contribution Productive des Infrastructures Publiques. Analyses Positives et Normatives"*, sous la direction de Pierre-Yves Hénin et soutenue le 18 janvier 2000.

1995-1996 : Magistère d'Economie et D.E.A. Macroéconomie, Modélisation et Conjoncture, *Université Paris I Panthéon-Sorbonne*, Mention Très Bien.

Responsabilités Administratives et Pédagogiques

Directeur des Etudes du **Master Econométrie et Statistique Appliqué** (ESA) de l'Université d'Orléans (responsable Gilbert Colletaz).

Membre élu du Conseil de Gestion de la Faculté de Droit, d'Economie et de Gestion d'Orléans (depuis 2006).

Membre de la commission d'audit financier de la Faculté de Droit, d'Economie et de Gestion d'Orléans (2006)

Membre de la Commission de spécialistes de l'Université d'Orléans (depuis 2004).

Membre de la Commission de spécialistes de l'Université du Maine (depuis 2003).

Enseignements en cours

Statistique Mathématique (Licence 3, Economie et Gestion, Université d'Orléans)

Econométrie des variables qualitatives (Master 1 ESA, Université d'Orléans)

Econométrie pour la finance (Master 2 ESA, Université d'Orléans)

Regression non et semi paramétrique (Master 2 ESA, Université d'Orléans)

Macro-économtrie (Master 2 ESA, Université d'Orléans)

Econométrie de la volatilité et de la VaR (Master Ingénierie Economique et Financière, Université Paris Dauphine)

Econométrie pour la Finance, ESC Toulouse, Advanced Finance Program

Thèmes de recherche

Econométrie appliquée : Econométrie des données de panel, Macro-Econométrie, Econométrie pour la finance, Econométrie non linéaire

Recherche

Responsable de l'axe **Econométrie** du **LEO** (UMR CNRS 6221).

Membre du comité de direction du réseau **Methods in International Finance Network** (depuis 2006)

Membre du conseil de laboratoire du Laboratoire d'Economie d'Orléans (depuis 2004).

Co-responsable (avec J.P. Pollin et R. Breton) du séminaire jeunes doctorants du LEO

Liste des travaux et publications

Publications dans des revues à comité de lecture

- [1] Hurlin C. et Tokpavi S. (2007), "Une Evaluation des Procédures de Backtesting : Tout va pour le Mieux dans le Meilleur des Mondes", à paraître dans *Finance*.
- [2] Hurlin, C (2007), "What would Nelson and Plosser find had they used panel unit root tests?", à paraître dans *Applied Economics*.
- [3] Fouquau J., Hurlin C. et Rabaud I. (2007), "The Feldstein-Horioka Puzzle: a Panel Smooth Transition Regression Approach", à paraître dans *Economic Modelling*.
- [4] Destais G, Fouquau J. and Hurlin C. (2007), "Energy Demand Models : A Threshold Panel Specification of the Kuznets Curve", à paraître dans *Applied Economic Letters*.
- [5] Hurlin C. et Mignon, V. (2007), "Une Synthèse des Tests de Cointégration sur Données de Panel", à paraître dans *Economie et Prévision*.
- [6] Hurlin C. et Tokpavi S. (2007), "Un Test de Validité de la Value-at-Risk", *Revue Economique*, 58(3), pp 599-608.
- [7] Hurlin C. et Kierzenkowski, R (2007), "Credit Market Disequilibrium in Poland: Can we find what we expect? Non Stationarity and the Short Side Rule", *Economic Systems*, 31(2), pp 157-183.
- [8] Hurlin C. et Tokpavi S. (2006), "Bactesting Var Accuracy : A Simple New Test", *Journal of Risk*, vol 9, n°2, pp. 19-39.
- [9] Hurlin C. et Mignon V. (2005), "Une Synthèse des Tests de Racine Unitaire en sur Données de Panel", *Economie et Prévision*, 169-171, pp.251-295.
- [10] Hurlin C. (2005), "Un Test Simple de l'Hypothèse de Non Causalité dans un Modèle de Panel Hétérogène", *Revue Economique*, 56(3), pp. 799-809.
- [11] Hurlin C. (2005), "A Comment on The Dynamic Macroeconomic Effects of Public Capital". C. Kamps. Springer, *Journal of Economics*, Books Review.
- [12] Clément D., Hurlin C. et Serres F. (2005), "Downgrading in the First Job: Who and Why?", *Applied Economic Letters*, 12(4), pp. 227-233.
- [13] Hurlin C. (2001), "Estimating the productive contribution of public capital with times series production functions: a case of unreliable inference", *Applied Economic Letters*, Volume 8, n°2, pp. 99-103, 2001.
- [14] Gaulier G., Hurlin C. et Jean-Pierre P. (1999), "Testing convergence: A panel data approach", *Annales d'Economie et de Statistiques*, n°55-56, pp. 411-428.

- [15] Hurlin C. et Portier F. (1999), "Taux d'actualisation public, distorsions fiscales et croissance : modélisation et application à l'économie française", *Annales d'Economie et de Statistiques*, n°54, pp. 173-201.
- [16] Hurlin C. (1999), "La contribution productive du capital public à la croissance : Estimation sur un panel sectoriel de dix pays de l'OCDE", *Economie et Prévision*, n°137, pp. 49-66.
- [17] Hurlin C. et Portier F. (1996), "Le partage de la valeur ajoutée dans le cycle. Quelques pistes de modélisation en équilibre général", *Economie et Prévision*, n°125, pp. 73-85.

Contribution à Ouvrage

- [1] Destais G, Fouquau J. and Hurlin C. (2006), "Economic Development and Energy Intensity: a Panel Data Analysis", in *The Econometrics of Energy Systems*, Bourbonnais R., Chevalier, J.M and Keppler, J.H, eds. Palgrave.

Autres Publications et Documents de Travail

- [1] Hurlin C. (2006), "Networks Effects in the Productivity of Infrastructures in Developing Countries", *World Bank Policy Research Working Papers* 3808. *Article en révision pour la revue European Economic Review.*
- [2] Arestoff F. et Hurlin C. (2006), "Estimates of Government Net Capital Stocks for 26 Developing Countries, 1970-2002", *World Bank Policy Research Working Papers* 3858.
- [3] Hurlin C. et R. Kierzenkowski R. (2004), "Credit Market Disequilibrium in Poland: Can we find what we expect? Non Stationarity and the Min Condition", Working Paper Series, *William Davidson Institute*, 581, June 2003.
- [4] Hurlin C. et R. Kierzenkowski R. (2002), "A Theoretical and Empirical assessment of the bank lending channel and loan market disequilibrium in Poland", *Working Paper 22, National Bank of Poland*, Research Department.
- [5] Hurlin, C. et N'Diaye, P. (1998), "La méthode d'estimation des Fully Modified ou Moindres Carrés Modifiés : Avantages et limites.", *Cahiers Eco-Maths* 98.26, Université de Paris I

Articles soumis et Articles en Révision

- [1] Colletaz G. et Hurlin C. (2006), "Threshold Effects in the Public Capital Productivity: An International Panel Smooth Transition Approach", *Document de Recherche LEO* 2006-04. *Article en révision pour Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*

- [2] Hurlin C. et Lechevalier S. (2005), "The Heterogeneity of Employment Adjustment Across Japanese Firms. A Study Using Panel Data", *Couverture Orange CEPREMAP. Article en révision pour Industrial Relations*
- [3] Hurlin C. (2004), "Testing Granger causality in Heterogeneous panel data models with fixed coefficients", *Document de Recherche LEO 2004-05*.

Travaux en cours

- [1] Colletaz G., Hurlin C. et Tokpavi S. (2007), "Irregularly Spaced Intraday Value-at-Risk (ISIVaR) Models: Forecasting and Predictive Abilities"
- [2] Hurlin C. (2003), "How to Estimate the Productivity of Public Capital?", *Document de Recherche LEO 2003-13*.

Contrats de Recherche

- [1] Colletaz G. et Hurlin C. (2007), Rapport de recherche pour L'Institut pour la Recherche de la Caisse des Dépôts et Consignations sur le thème "Modèles à Changement de Régimes et Prévisions Macro-économiques "
- [2] Hurlin (2005), Rapport de Recherche pour la Banque Mondiale sur le thème "The productivity Effects of Public Capital in Developing Countries". Evaluations économétriques de la productivité des investissements publics et des investissements d'infrastructure sur un panel de pays en voie de développement.
- [3] Participation à un rapport finalisé de contrat pour le Commissariat Général au Plan (1998), "Evaluation de la contribution productive des investissements publics", sous la direction de PY Hénin (CEPREMAP).

Activités de Referee

Annales d'Economie et de Statistiques, Economie et Prévision, Revue Economique, Revue d'Economie Politique, Revue d'Economie Industrielle, Compte Rendus de l'Académie des Sciences et Journal of Economics, Oxford Bulletin of Economic and Statistics, Economic Issues.

Communications Choisies

University of Maastricht, 1st Workshop, Methods in International Finance Network, 24-25 septembre 2007

Université Paris X Nanterre, Séminaire invité EconomX, 08 Mars 2007

STATEC, Econométrie de Panel, Luxembourg, 6-7 janvier 2007

Journée d'Econométrie pour la Finance, Université Paris X, 23 novembre 2006

Colloque de l'AFSE, Paris, 14-15 septembre 2006

Econometric Society European Meeting (ESEM), Vienne, 24-28 août 2006

13th International Conference on Panel Data, Cambridge, 7-9 Juillet 2006

Banque Mondiale, Washington, 28 Mai 2005

Colloque de l'AFSE, 16 et 17 septembre 2004

20th Symposium on Monetary and Financial Economics, Birmingham, 5-6 June 2003

Econometric Society European Meeting (ESEM), Lausanne, 23-25 Août 2001.

Econometric Society European Meeting (ESEM), S.J.Compostelle, 29-31 Août 1999.

V^{ème} Conférence Internationale d'Economie Publique, Brest 10-11 Juin 1999.

Théories et Méthodes de la Macroéconomie, Marseille, 22-23 Mai 1998.

7th International Conference on Panel Data, Paris, 19-20 Juin 1997.

Econometric Society European Meeting (ESEM), Toulouse, 27-30 Août 1997

Colloque de l'AFSE, Paris, 18-19 Septembre 1997.

Théories et Méthodes de la Macroéconomie, Louvain la Neuve, 23-24 Mai 1997.

Encadrement Doctoral

Titulaire de la PEDR depuis Octobre 2006

Julien Fouquau (depuis novembre 2004), en co-direction avec Melika Ben Salem (Université de Marne la Vallée). Titre de la thèse : "*Modèles de Panel à Changements de Régimes*". Financement : Allocation Régionale, Soutenance prévue courant 2008

Sessi Tokpavi (depuis novembre 2005), en co-direction avec Gilbert Colletaz (Université d'Orléans). Titre de la thèse : "*Méthodes de Validation de la Value-at-Risk*", Financement : Allocation MESR, Soutenance prévue fin 2008

Sidina Ould El Medani (depuis novembre 2007), en co-direction avec Gilbert Colletaz (Université d'Orléans). Titre de la thèse : "*Méthodes Paramétriques et Non Paramétriques de Prédiction de la Value-at-Risk*", Financement : Allocation Régionale