

Olivier DARNÉ

CURRICULUM VITAE

Né le 11 juin 1971 (33 ans)

Adresse professionnelle

Eurequa
Maison des Sciences Economiques
106-112 Boulevard de l'Hôpital
75013 Paris
Tél : 01 44 07 82 13
Email : olidarne@free.fr

Adresse personnelle

15 Place Wicklow
78180 Montigny-Le-Bretonneux
Tél : 01 30 96 66 93
Portable : 06 75 12 45 64

FONCTION ACTUELLE

2005-2006 : Post-Doc à l'EUREQua, Université Paris I.

FONCTIONS ANTERIEURES

2004-2005 : Chercheur Associé au CERESUR, Université de La Réunion.

2003-2004 : Chercheur Associé au LAMETA, Université de Montpellier I.

2001-2003 : Attaché Temporaire d'Enseignement et de Recherche (ATER).

1998-2001 : Allocataire de Recherche du Ministère de l'Education Nationale, de la Recherche et de la Technologie (MENRT).

DIPLOMES ET FORMATIONS UNIVERSITAIRES

Décembre 2002 : Doctorat en Sciences Economiques, Université Montpellier I.

« La Désaisonnalisation des Chroniques Economiques : Analyse des conditions conjoncturelles »

Distinction : Mention très honorable avec les félicitations du jury à l'unanimité et proposition de subvention pour publication.

Jury : Estella Bee DAGUM (Professeur, Université de Bologne, Rapporteur) – Valérie MIGNON (Professeur, Université Paris X, Rapporteur) – Raymond COURBIS (Professeur, Université Paris X, Président du jury) – Renaud LACROIX (INSEE, Banque de France, Suffragant) – Michel TERRAZA (Professeur, Université Montpellier I, Directeur de thèse).

1997-1998 : DEA de Micro-économie et Calculs Economiques, Université Montpellier I.
Mention Bien.

1995-1997 : Maîtrise et Licence de Sciences Economiques, Université de Perpignan.
Mention Bien

1993-1995 : DEUG de Sciences Economiques, Université de Perpignan.

1991-1993 : DEUG de Mathématiques et Sciences Physiques, Université de Perpignan.

ACTIVITES DE RECHERCHE

PUBLICATIONS

- à paraître [1] « Chocs temporaires et permanents dans le PIB de la France, du Royaume-Uni et des Etats-Unis », **Revue d'Economie Politique** (avec C. Diebolt).
- 2005 [2] « Relevance of detecting outliers in GARCH models for modelling and forecasting financial data », **Finance**, 26 (1) (avec A. Charles).
- [3] « Outliers and GARCH models in daily financial data », **Economics Letters**, 86 (3), 347-352 (avec A. Charles).
- 2004 [4] « Unit root and infrequent large shocks: New international evidence on output », **Journal of Monetary Economics**, 51 (7), pp. 1449-1465 (avec C. Diebolt).
- [5] « Les méthodes et logiciels de désaisonnalisation en économie : une revue de la littérature », **Journal de la Société Française de Statistique**, 145 (4).
- [6] « Seasonal cointegration for monthly data », **Economics Letters**, 82 (3), pp. 349-356.
- [7] « Forecasts of the seasonal fractional integrated series », **Journal of Forecasting**, 23, pp. 1-17 (avec V. Guiraud et M. Terraza).
- [8] « The effects of additive outliers on stationarity tests: A Monte Carlo study », **Economics Bulletin**, 3 (16), pp. 1-8.
- 2003 [9] « Maximum likelihood seasonal cointegration tests for daily data », **Economics Bulletin**, 3 (18), pp. 1-8.
- [10] « La réserve monétaire de la Reichsbank, 1876-1920. Une analyse cliométrique », **Economies et Sociétés, Série AF**, 29 (1), pp. 25-42 (avec C. Diebolt).
- 2002 [11] « A note on seasonal unit root tests », **Quality and Quantity**, 36, pp. 305-310 (avec C. Diebolt).
- [12] « Tests de racines unitaires saisonnières pour des données journalières », **Revue de Statistique Appliquée**, L(2), pp. 71-91 (avec J. Litago et M. Terraza).
- 2000 [13] « Explorations in Monetary Cliometrics: The Reichsbank, 1876-1920 », **Historical Social Research**, 25 (3/4), pp.23-35 (avec C. Diebolt).

ARTICLES EN REVISION

- [1] « Large shocks and the September 11th terrorist attacks: An intervention analysis approach on international stock markets », soumis à **Economic Modelling** (avec A. Charles).
- [2] « Likelihood analysis of seasonal cointegration », soumis à **Journal of Economic Surveys**.
- [3] « The effects of outliers on unit root tests with structural breaks », soumis à **Communications in Statistics – Simulation and Computation**.

OUVRAGES

New Trends in Macroeconomics, **Editions Springer, Berlin** (avec Diebolt C.; Kyrtsov C.).

- [1] « Nonstationarity Tests of Macroeconomic Time Series », dans Diebolt C.; Kyrtsov C. et la collaboration de O. Darné (eds) *New Trends in Macroeconomics*, **Editions Springer, Berlin** (avec C. Diebolt).

ARTICLES SOUMIS A DES REVUES

- [1] « The uncertain unit roots in real GNP: A re-examination », soumis à **Journal of Macroeconomics**.
- [2] « A note on “Distribution theory for unit root tests with conditional heteroskedasticity” », soumis à **Economics Bulletin** (avec A. Charles).
- [3] « The purchasing power parity in Australia: Evidence from unit root tests with structural breaks », soumis à **Bulletin of Economic Research** (avec J-F. Hoarau).
- [4] « Performance of short-term trend predictors of model-based and moving average seasonal adjustment methods for current economic analysis », soumis à **Journal of Business and Economic Statistics** (avec E. Dagum).

COMMUNICATIONS

- 2005** [1] « *The purchasing power parity in Australia: Evidence from unit root tests with structural breaks* »
- 54^{ème} Congrès Annuel de l'AFSE (Association Française de Sciences Economiques), Paris.
 - Conference on Unit root and Cointegration Testing, Faro (Portugal).
- [2] « *Tester la parité du pouvoir d'achat dans l'économie chinoise* »
- Colloque « L'économie chinoise au cœur de la croissance mondiale ? », Rennes.
- 2004** [3] « *Outliers and GARCH models in daily financial data* »
- Colloque Econométrie des Valeurs Boursières, Paris.
- [4] « *Unit root and infrequent large shocks: New international evidence on output* »
- 8^{ème} Conférence Internationale T2M (Théories et Méthodes de la Macroéconomie), Orléans.
- 2003** [5] « *Exchange rate regime classification and real performances: New empirical evidence* »
- 35th Annual Conference on Money Macro and Finance, Cambridge.
 - 20^{ème} Journées Internationales d'Economie Monétaire et Bancaire, Birmingham.
- [6] « *Outliers et anomalies saisonnières* »
- 20^{ème} Conférence Internationale de l'AFFI (Association Française de Finance), Lyon.
- [7] « *A new trend-cycle predictor for current economic analysis* »
- 23rd International Symposium on Forecasting, Mexico.
- 2002** [8] « *Chocs temporaires et permanents en Europe aux XIXème et XXème siècle* »
- 51^{ème} Congrès Annuel de l'AFSE (Association Française de Sciences Economiques), Paris.
- [9] « *Analyse de vraisemblance de la cointégration saisonnière* »
- 7^{ème} Colloque des Jeunes Economètres, Strasbourg.

- 2001** [10] « *La Reichsbank, 1876-1920 : Une analyse institutionnelle et cliométrique* »
• Colloque National de l'AFHE (Association Française d'Histoire Economique), Paris.
- 2000** [11] « *Comparison of standard and fractional seasonal unit root tests: Application to the consumer price index in France* ».
• 20th International Symposium on Forecasting, Lisbonne.
• 10^{ème} Journées du SESAME (Séminaire d'Etudes et de Statistiques Appliquées à la Modélisation en Economie), Dijon.
- [12] « *Explorations in Monetary Cliometrics : The Reichsbank, 1876-1920* »
• 5th International Conference on Social Science Methodology, Cologne.
- 1999** [13] « *Tests de racines unitaires saisonnières de périodicité impaire* »
• 9^{ème} Journées du SESAME (Séminaire d'Etudes et de Statistiques Appliquées à la Modélisation en Economie), Saint-Étienne.

RAPPORTEUR POUR DES REVUES

2005 : Journal of Applied Econometrics

CONTRAT DE RECHERCHE

2005 : Participation à un contrat de recherche du Ministère de l'Éducation Nationale, de l'Enseignement Supérieur et de la Recherche, Direction de l'Enseignement Supérieur et Direction de l'Évaluation et de la Prospective. *Réalisation d'une étude sur les liens entre éducation et croissance.*

2001-2003 : Participation au contrat de recherche Aides à Projets Nouveaux (APN) du CNRS. *Analyse cliométrique de la relation éducation-croissance en Europe aux 19^{ème} et 20^{ème} siècle.*

ENSEIGNEMENT

1999-2003 : Chargé de Travaux Dirigés en Statistique et en Microéconomie en 2^{ème} année de Sciences Economiques, Université Montpellier I.
Interventions dans le séminaire d'Économétrie du DEA en Sciences Economiques.

1998-1999 : Chargé de Travaux Dirigés en Statistique en 1^{ère} année et en Informatique en 2^{ème} année d'Administration Economique et Sociale, Université de Perpignan.

BOURSES

1997-1998 : Bourse d'Etude pour le DEA.

RESPONSABILITES COLLECTIVES

2001-2003 : Coresponsable des séminaires du LAMETA, Université Montpellier I.
Secrétaire Général de l'Association Française de Cliométrie (AFC).

2000-2003 : Vice-président de l'Association des Doctorants et des jeunes Docteurs en Economie de Montpellier (ADDEM).