

Olivier DARNÉ

CURRICULUM VITAE

Adresse professionnelle

LEMNA
Université de Nantes
IEMN-IAE
Chemin de la Censive du Tertre, BP 52231
44322 Nantes
Tél. : 02 40 14 17 33
Email : olivier.darne@univ-nantes.fr

FONCTIONS ACTUELLES

Professeur des universités à l'Université de Nantes
http://www.iemniae.univ-nantes.fr/darne-o/0/fiche_annuaireksup/&RH=IAE_FR1

Consultant à la Banque de France
<http://www.banque-france.fr/gb/publications/chercheurs/Darne.htm>

FONCTIONS ANTERIEURES

Septembre 2006 – août 2008 : Maître de Conférences à l'Université Paris X – Nanterre

Décembre 2005 – août 2006 : Economiste, Chargé de mission, Banque de France

Septembre 2005 – novembre 2005 : Post-Doc à l'EUREQua, Université Paris I.

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), Université de Montpellier.

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

DIPLOMES ET FORMATIONS UNIVERSITAIRES

Habilitation à Diriger des Recherches en Sciences Economiques

Université Paris X - Nanterre (juin 2007)

Sujet : « *Saisonnalité, persistance et études d'évènements* »

Jury : Hélène Raymond (Professeur, Université Paris X) ; Sanvi Avouyi-Dovi (Economiste, Banque de France) ; Christophe Hurlin (Professeur, Université d'Orléans) ; Fabien Tripier (Professeur, Université de Nantes) ; Valérie Mignon (Professeur, Université Paris X, Directrice).

Thèse de Doctorat en Sciences Economiques

Université Montpellier I (décembre 2002)

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

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

THEMES DE RECHERCHE

- Econométrie (C12, C14, C22, C32, C51, C53)
- Macroéconomie (N1, E32)
- Finance (F31, G14, G15)

PUBLICATIONS

- à paraître « Un indicateur probabiliste du cycle d'accélération pour l'économie française », **Economie et Prévision** (avec M. Adanero-Donderis et L. Ferrara).
- « The efficiency of the crude oil markets: Evidence from variance ratio tests », **Energy Policy** (avec A. Charles).
- « Testing for random walk behavior in Euro exchange rates », **Economie Internationale** (avec A. Charles).
- « Are disaggregate data useful for factor analysis in forecasting French GDP? », **Journal of Forecasting** (avec K. Barhoumi et L. Ferrara).
- 2009 « Variance ratio tests of random walk: An overview », **Journal of Economic Surveys**, 23 (3), 503-527 (avec A. Charles).
- « The random walk hypothesis for Chinese stock markets: Evidence from variance ratio tests », **Economic System**, 33 (2), pp. 117-126 (avec A. Charles)
- « Spurious rejections with endogenous break unit root tests in the presence of outliers and breaks », **Communications in Statistics – Simulation and Computation**, 38(5), pp. 1037-1050.
- « The uncertain unit roots in real GNP: A re-examination », **Journal of Macroeconomics**, 31, pp. 153-166.
- « Performance of short-term trend predictors for current economic analysis », **Economics Bulletin**, 29 (1), pp. 79-89 (avec E.B. Dagum).
- 2008 « A note on unit root tests and GARCH errors: A simulation experiment », **Communications in Statistics – Simulation and Computation**, 37 (1-2), pp. 314-319 (avec A. Charles).
- « La parité des pouvoirs d'achat pour l'économie chinoise : une nouvelle analyse par les tests de racine unitaire », **Recherches Economiques de Louvain**, 74 (2), pp. 219-236 (avec J-F. Hoarau).
- « The impact of outliers on transitory and permanent components in macroeconomic time series », **Economics Bulletin**, 3 (60), pp. 1-9 (avec A. Charles).
- « Using business survey in industrial and services sector to nowcast GDP growth: The French case », **Economics Bulletin**, 3 (32), pp. 1-8.
- 2007 « The purchasing power parity in Australia: Evidence from unit root test with structural break », **Applied Economics Letters**, 15 (3), pp. 203-206.
- « Re-examining the purchasing power parity in Australia », **Bulletin of Economic Research** 59 (4), pp. 383-395 (avec J-F. Hoarau).
- « Cliometrics of academic careers and the impact of infrequent large shocks in Germany before 1945 », **Empirical Economics Letters**, 6(3), pp. 173-183 (avec C. Diebolt).

- 2006** « Large shocks and the September 11th terrorist attacks: An intervention analysis approach on international stock markets », **Economic Modelling**, 23 (4), pp. 683-698 (avec A. Charles).
- « Chocs temporaires et permanents dans le PIB de la France, du Royaume-Uni et des Etats-Unis », **Revue d'Économie Politique**, 116 (1), pp. 65-78 (avec C. Diebolt).
- 2005** « Relevance of detecting outliers in GARCH models for modelling and forecasting financial data », **Finance**, 26 (1), pp. 33-71 (avec A. Charles).
- « Outliers and GARCH models in daily financial data », **Economics Letters**, 86 (3), 347-352 (avec A. Charles).
- 2004** « Unit root and infrequent large shocks: New international evidence on output », **Journal of Monetary Economics**, 51 (7), pp. 1449-1465 (avec C. Diebolt).
- « Les méthodes et logiciels de désaisonnalisation en économie : une revue de la littérature », **Journal de la Société Française de Statistique**, 145 (4).
- « Seasonal cointegration for monthly data », **Economics Letters**, 82 (3), pp. 349-356.
- « Forecasts of the seasonal fractional integrated series », **Journal of Forecasting**, 23 (1), pp. 1-17 (avec V. Guiraud et M. Terraza).
- « The effects of additive outliers on stationarity tests: A Monte Carlo study », **Economics Bulletin**, 3 (16), pp. 1-8.
- 2003** « Maximum likelihood seasonal cointegration tests for daily data », **Economics Bulletin**, 3 (18), pp. 1-8.
- « 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** « A note on seasonal unit root tests », **Quality and Quantity**, 36 (3), pp. 305-310 (avec C. Diebolt).
- « 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** « Explorations in Monetary Cliometrics: The Reichsbank, 1876-1920 », **Historical Social Research**, 25 (3/4), pp.23-35 (avec C. Diebolt).

ARTICLES EN RÉVISION

- « Further evidence on trends and random walks in macroeconomic time series », *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics* (avec A. Charles).

OUVRAGES

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

« 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), pp. 173-194, 2005.

« La Reichbank, 1876-1920 : une analyse institutionnelle et cliométrique », dans Vuillermet (ed.) *La monnaie, personnage historique*, Revue Européenne des Sciences Sociales, Cahiers Vilfredo Pareto, Droz
(avec C. Diebolt), 45 (137), pp. 203-212, 2007.

ARTICLES DANS DES REVUES SANS COMITE DE LECTURE

« Pourquoi calculer un indicateur du climat des affaires dans les services ? »,
Bulletin de la Banque de France, n°171, pp. 23-29, 2008 (avec V. Brunhes-Lesage).

« OPTIM : un outil de prévision trimestrielle du PIB de la France », **Bulletin de la Banque de France**,
n°171, pp. 31-42, 2008 (avec K. Barhoumi, V. Brunhes-Lesage, L. Ferrara, B. Pluyaud et B. Rouvreau).

« L'indicateur synthétique mensuel d'activité (ISMA) : une révision », **Bulletin de la Banque de France**,
n°162, pp. 21-36, 2007 (avec V. Brunhes-Lesage).

DOCUMENTS DE TRAVAIL ET MIMEO

« Are disaggregate data useful for factor analysis in forecasting French GDP? »,
Notes d'Etudes et de Recherche, Banque de France, n°232, 2009 (avec K. Barhoumi et L. Ferrara).
<http://www.banque-france.fr/fr/publications/ner/ner232.htm>

« Monthly forecasting of French GDP: A revised version of the optim model »,
Notes d'Etudes et de Recherche, Banque de France, n°222, 2008 (avec K. Barhoumi, V. Brunhes-Lesage,
L. Ferrara, B. Pluyaud et B. Rouvreau).
<http://www.banque-france.fr/fr/publications/ner/ner222.htm>

« Deux indicateurs probabilistes de retournement cyclique pour l'économie française »,
Notes d'Etudes et de Recherche, Banque de France, n°187, 2007 (avec M. Adanero-Donderis et L.
Ferrara).
<http://www.banque-france.fr/fr/publications/ner/ner187.htm>

« L'indicateur synthétique mensuel d'activité (ISMA) : une révision »,
Notes d'Etudes et de Recherche, Banque de France, n°171, 2007 (avec V. Brunhes-Lesage).
<http://www.banque-france.fr/fr/publications/ner/ner171.htm>

« Testing the purchasing power parity in China »,
Document de Travail No 2006-18, EconomiX, Université Paris X, (avec J-F. Hoarau).
http://economix.u-paris10.fr/pdf/dt/2006/WP_EcoX_2006-18.pdf

COMMUNICATIONS

Congrès Annuel de l'AFSE ; Conference on Unit root and Cointegration Testing ; Colloque Econométrie des Valeurs Boursières ; Conférence Internationale T2M ; Conference on Money Macro and Finance ; Journées Internationales d'Economie Monétaire et Bancaire ; Conférence Internationale de l'AFFI ; International Symposium on Forecasting ; Colloque des Jeunes Economètres ; Colloque National de l'AFHE ; Journées du SESAME ; International Conference on Social Science Methodology ; EABCN workshop on Uncertainty over the business cycle.

RAPPORTEUR POUR DES REVUES

Journal of Applied Econometrics ; Economie Internationale ; Cliometrica ; Economie et Prévision ; Applied Economics ; Annales d'Economie et de Statistique.

COMITE EDITORIAL

Membre du comité éditorial de la revue **Cliometrica**

CONTRAT DE RECHERCHE

2005 : Participation à un contrat de recherche du Ministère de l'Education Nationale, de l'Enseignement Supérieur et de la Recherche, Direction de l'Enseignement Supérieur et Direction de l'Evaluation 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

L1 : Techniques Quantitatives (cours) Statistiques (TD) ; Macroéconomie (TD)

L2 : Statistiques (cours + TD) ; Microéconomie (TD)

L3 : Marchés de capitaux (cours) ; Mathématiques financières (cours)

M1 : Econométrie (cours + atelier) ; Techniques Quantitatives (cours + TD)

M2 : Econométrie (cours) ; Statistiques des risques financiers