

3^{ème} Journée de l'Atelier Finance & Risque du LEMNA
Université de Nantes, IEMN-IAE, bâtiment Erdre, Salle des Actes

Vendredi 12 mars 2010

Econométrie Financière

9h00 – 9h15	Accueil des participants
9h15 – 10h00	Backtesting Value-at-Risk: A GMM duration-based test Bertrand Candelon (Université de Maastrich), Gilbert Colletaz (Université d'Orléans, LEO), <u>Christophe Hurlin</u> (Université d'Orléans, LEO) et Sessi Tokpavi (Université Paris 10, EconomiX) <i>Discutante : Loredana Ureche-Rangau (Université d'Amiens, CRIISEA)</i>
10h00 – 10h45	Outlyingness weighted quadratic covariation Kris Boudt (KU Leuven), et Christophe Croux (KU Leuven) et <u>Sébastien Laurent</u> (Université de Namur) <i>Discutant : Benoit Sévi (Université d'Angers, LEMNA)</i>
10h45 – 11h15	Pause café
11h15 – 12h00	On equilibrium exchange rates: Is emerging Asia different? Antonia López-Villavicencio (Université Paris 13, CEPN) et <u>Valérie Mignon</u> (Université Paris 10, EconomiX, et CEPII) <i>Discutant : Nicolas Rautureau (Université de Nantes, LEMNA)</i>
12h00 – 12h45	Testing the martingale difference hypothesis in major foreign exchange rates Amélie Charles (Audencia, School of Management), <u>Olivier Darné</u> (Université de Nantes, LEMNA) et Jae Kim (La Trobe University) <i>Discutant : Julien Chevallier (Université Paris Dauphine)</i>
13h00 – 14h30	Déjeuner
14h45 - 15h30	(Re)correlation: a Markov switching multifractal model with time varying correlations <u>Julien Idier</u> (Banque de France) <i>Discutant : Gilbert Colletaz (Université d'Orléans, LEO)</i>
15h30– 16h15	Revisiting the excess co-movement of commodity prices in a data-rich environment <u>Yannick Le Pen</u> (Université de Nantes, LEMNA) et Benoit Sévi (Université d'Angers, LEMNA) <i>Discutant : Laurent Ferrara (Banque de France)</i>
16h15 – 16h30	Clôture : Fabien Tripier (Université de Nantes, LEMNA)

Organisateurs

Olivier Darné (olivier.darne@univ-nantes.fr)
Yannick Le Pen (yannick.le-pen@univ-nantes.fr)

Organisateurs de l'Atelier Finance & Risque

Sophie Pardo (sophie.pardo@univ-nantes.fr)
Nicolas Rautureau (nicolas.rautureau@univ-nantes.fr)
Benoît Sévi (benoit.sevi@gmail.com)