

1^{ère} Journée d'Econométrie Appliquée

20 Mai 2022 - Montpellier, France

Conférence internationale en Econométrie Appliquée

Michel
Terraza

Programme de la Journée

8h – 9h : Accueil enregistrement café

9h – 10h : Ouverture par François Mirabel, Doyen de la Faculté d'Economie.

10h – 10h30 : Speaker : Ftiti Zied

Portfolio Strategies: new evidence from Volatility Decomposition

Ftiti Zied, H.Ben Ameer, W. Louhichi, J.L. Prigent

10h30 -12h30 : Session Econométrie Appliquée à la Finance

Portfolio allocation under Knightian uncertainty with possibility measures

Alfred Mbairadjim Moussa

Etude de la relation dynamique entre les prix spots et à terme : Cas du marché du pétrole

El Bouazizi Said, Ed-Dafali Slimane

Évaluation du Risque Marché dans un Contexte de Crise : Cas de la crise Covid-19

Serghini Yousra, Solhi Sanae, Bezzaz Mariem

La gestion des risques liés aux dépôts d'investissement à l'égard de la réglementation Bâloise

Chati Youssef, Solhi Sanae

12H30 – 14H00 Buffet Repas

Présence de Philippe Augé, Président de l'Université de Montpellier

14h00 -16h00 : Session Econométrie des Séries Temporelles

Estimation en temps réel de la tendance-cycle : apport de l'utilisation des filtres asymétriques dans la détection des points de retournement

Alain Quartier-La-Tente

A New Approach to Study Random Extended Intervals and their ARMA Processes,

Babel Raïssa, Guemdjo Kamdem, Jules Sadefo Kamdem, Carlos Ogouyandjou

Hybrid Forecasting Methodology for Electricity Consumption Based on a Seasonal ARIMA and MLP Models with Climatic Variables: Evidence from Morocco

Sid'Ahmed Soumbara and Ahmed El Ghini

Adaptive Hyperbolic Asymmetric Power ARCH (A-HY-APARCH) model: Stability and Estimation

Charline Uwilingiyimana, Abdou Ka Diongue, Carlos Ogouyandjou

16h-16h30 : Poster Session ; Pause-Café

A Continuous Wavelets approach of China opening reforms effects on relationships between Mainland Chinese stock exchanges and Hong Kong

Yang Zhou

Energy, Debt and Growth: Continuous Wavelet Analysis

Mohamed Awada

Le marché d'électricité en France et les crises géopolitiques

Boumediene Souiki, Ayad Assoil

16h30 – 17h : Speaker : Costas Siriopoulos, Dionisis Philippas

Putting Corona into Hedge Fund Managers' Head

Costas Siriopoulos, Dionisis Philippas

17h00 -18h30 : Économétrie Appliquée au Marché du Travail, à l'Immobilier et à l'Environnement

Wage rigidity and business cycle characteristics of the Moroccan labor Market

Lakhchen Faical

Who is more willing to protect the environment? Understanding the drivers environmental actions from Maslow's hierarchy of needs model,

Sebastián Irigoyen

Structural changes in temperature and precipitations in MENA countries

Hassan Amouzay, Raja Chakir, Sophie Dabo-Niang, Ahmed El Ghini

The housing price index and the number of housing units: a surprising co-movement in France!

Bator Anne , Blanchard Hervé

18h30 Clôture : Valérie Mignon



**FACULTÉ
D'ÉCONOMIE**

