

Hamdi RAÏSSI

Maître de conférences à l'INSA de Rennes

Né le 5 décembre 1978 à Audincourt (25) de nationalité tunisienne
Célibataire sans enfant

Adresse

20, avenue des buttes Coësmes, CS 14315, F-35043 Rennes Cedex.

Téléphone

Fixe : 02 23 23 82 36

Mobile : 06 37 43 65 12

Courriel : Hamdi.Raissi@insa-rennes.fr

Page web : <http://perso.univ-lille3.fr/~hraissi>

ACTIVITES DE RECHERCHE

PUBLICATIONS

- « Autocorrelation based tests for vector error correction models with uncorrelated but nonindependent errors ». En révision pour la revue *Test*.
- « Testing the cointegrating rank when the errors are uncorrelated but nonindependent », *Stochastic Analysis and Applications*. Accepté. Un résumé de cet article est disponible en version française sous la référence suivante.
- « Test du rapport de vraisemblance pour le rang de cointégration d'un VAR avec des erreurs dépendantes », *C. R. Acad. Sci. Paris, Ser. I* 346, 93-96, 2008.
- Avec C. Francq « Multivariate portmanteau test for autoregressive models with uncorrelated but nonindependent errors », *Journal of Time Series Analysis* 28, 454-470, 2007.

ARTICLES SOUMIS

- « Testing linear causality in mean in presence of other forms of causality », soumis.

COMMUNICATIONS

- « Autocorrelation based tests for vector error correction models with uncorrelated but nonindependent errors. » 63rd European Economic Meeting of the Econometric Society

(ESEM) 27-31 août 2008.

- « Autocorrelation based tests for vector error correction models with uncorrelated but nonindependent errors. » Computational and Financial Econometrics. Neuchâtel 19-21 juin 2008.
- « Autocorrelation based tests for vector error correction models with uncorrelated but nonindependent errors. » European Centre for Advanced Research in Economics and Statistics (ECARES). Bruxelles 14 février 2008.
- « Testing the cointegrating rank when the errors are uncorrelated but nonindependent. » Deuxièmes rencontres des jeunes statisticiens. Aussois 3-7 septembre 2007.
- « Testing the cointegrating rank when the errors are uncorrelated but nonindependent. » Journées de statistique fonctionnelle et opératoire. Lille 21-22 juin 2007.
- « Testing the cointegrating rank when the errors are uncorrelated but nonindependent. » 39èmes journées de statistique de la SFdS. Angers 11-15 juin 2007.
- « Testing the cointegrating rank when the errors are uncorrelated but nonindependent. » 2nd Tinbergen Institute Conference “20 Years of Cointegration: Theory and Practice in Prospect and Retrospect”. Rotterdam 23-24 mars 2007.
- « Testing the cointegrating rank when the errors are uncorrelated but nonindependent. » Université Lille3, GREMARS, 14 février 2007.

TRAVAUX UNIVERSITAIRES

- « Contribution à l’inférence statistique des modèles vectoriels autorégressifs et à correction d’erreurs », thèse de doctorat en mathématiques appliquées soutenue le 29 novembre 2007. Université Lille 3.
- « Modèles GARCH multivariés », mémoire pour l’obtention du DEA (Diplôme d’Etudes Approfondies), 2004.

AUTRES DOCUMENTS

- « Test du rapport de vraisemblance pour le rang de cointégration d’un VAR avec des erreurs dépendantes », *39èmes Journées de Statistique de la SFdS, 2007.*

ACTIVITES D’ARBITRAGE

- *Computational Statistics and Data Analysis*
- *Econometric Theory*
- *Recherches Economiques de Louvain*

FORMATIONS

2007 **Thèse de Doctorat en mathématiques appliquées**, Université Lille 3 Charles-De-Gaulle, « Contribution à l'inférence statistique des modèles vectoriels et à correction d'erreurs », sous la direction de M. Christian FRANCQ et M. Jean-Michel ZAKOÏAN, soutenue le 29 novembre 2007.

JURY:

M. Christian Francq, Professeur à l'Université Lille 3. (co-encadreur)
M. Jean-Michel Zakoïan, Professeur à l'Université Lille3. (co-encadreur)
M. Pierre Duchesne, Professeur à l'Université de Montréal. (rapporteur)
M. Jean-Pierre Florens, Professeur à l'Université Toulouse 1. (rapporteur)
Mme Laurence Broze, Professeur à l'Université Lille 3. (présidente du jury)
Examineur : M. Jian-Feng Yao, Professeur à l'Université Rennes 1. (examineur)

FORMATION INITIALE

2004 **Diplôme d'Etudes Approfondies (DEA) Mathématiques Appliquées et Sciences Economiques**, Université Lille 3 Charles-De-Gaulle (mention très bien)

2002 **Maîtrise en Mathématiques Fondamentales**, Université de Tunis El Manar

2000 **Diplôme d'Etudes Universitaires Premier Cycle Mathématiques-Physique-Informatique**, Université de Tunis El Manar

1998 **Baccalauréat Scientifique**, option Mathématiques

COMPETENCES

- **Statistiques descriptives et inférentielles** (régression linéaire, estimation, prévision...)
- **Traitement informatique des données** (JMulTi, SAS)
- **Programmation informatique** (Fortran, Mathematica 4)
- Anglais : lu, écrit, parlé
- Arabe : lu, parlé

PRESENTATION DE LA THESE _____

DOMAINES DE RECHERCHE

Statistique, économétrie, séries temporelles

RESUME

« Contribution à l'inférence statistique des modèles vectoriels et à correction d'erreurs »

Dans cette thèse nous élargissons le champ d'application des modèles vectoriels autorégressifs (VAR) en considérant des erreurs non corrélées mais dépendantes. Plus précisément, en

étudiant des problèmes d'estimation et de comportement d'outils statistiques, nous nous sommes intéressé à la validité dans notre cadre de résultats valables sous l'hypothèse d'innovations iid gaussiennes. Nous montrons que le comportement asymptotique des estimateurs des paramètres de court terme et des autocorrélations résiduelles est différent du cas standard. Ainsi des tests portmanteau modifiés dont la distribution asymptotique est une somme pondérée de chi-deux sont proposés. Nous présentons un algorithme qui permet d'implémenter ces tests. Le comportement des estimateurs des paramètres de long terme et du test de rapport de vraisemblance pour le rang de cointégration est étudié. Il apparaît que les résultats standard concernant les relations de long terme s'étendent à notre cadre. Nous montrons aussi que le comportement asymptotique des estimateurs des paramètres d'ajustement est différent du cas iid gaussien. Des exemples théoriques qui justifient notre approche sont exhibés. Le comportement à distance finie de différents tests est étudié par des expériences de Monte Carlo.

Mots Clés : Modèle vectoriel autorégressif; Modèle vectoriel à correction d'erreur; Bruit blanc faible; Cointégration; Autocorrélations résiduelles; Tests portmanteau; Test de rapport de vraisemblance; Estimateur spectral.