

CURRICULUM VITAE

Frédéric Karamé, né le 07 octobre 1972, Paris 12^{ième}. Marié, 2 enfants.

Fonctions actuelles :

Professeur d'Économie à Le Mans Université.
Directeur du GAINS-TEPP (FR n°2042, CNRS) depuis 2019.
Membre de l'Institut du Risque et de l'Assurance depuis 2013.
Membre de la DYNARE Team (ENS/CEPREMAP) depuis 2009.

Coordonnées professionnelles : Le Mans Université, avenue O. Messiaen, 72085 Le Mans CEDEX 9. Mail: frederic.karame@univ-lemans.fr / URL : <http://f.karame.free.fr>

Thèmes de recherche : Méthodes quantitatives appliquées à la macroéconomie et la finance, économétrie linéaire et non linéaire des séries temporelles, méthodes de résolution des modèles DSGE, modèles à composantes inobservables, inférence simulée, filtrage particulière, économétrie bayésienne.

PARCOURS ACADÉMIQUE

- 1995 **DEA d'Économie Mathématique et Économétrie**, mention bien (Paris I Panthéon-Sorbonne).
- 1995-1998 **Allocataire de recherche MRT** (EUREQUA, UMR n°8594 CNRS, Paris I Panthéon-Sorbonne).
- 1996-1998 **Moniteur** (Paris-Est Créteil).
- 1999-2001 **ATER** (mi-temps) (Paris-Est Créteil).
- 2000 **Doctorat de Sciences Économiques de l'université Paris I Panthéon-Sorbonne.**
Créations, suppressions et réallocations agrégées des emplois en France et aux États-Unis : modélisations théoriques et validations économétriques, mention très honorable et félicitations du jury, proposition pour un prix de thèse et subvention pour publication. Jury : G. Bresson, F. Langot, J.P. Laffargue, P. Sevestre et P.Y. Hénin (directeur de thèse).
- 2001-2012 **Maître de Conférences** à l'université d'Évry Val d'Essonne, **chercheur** EPEE-TEPP.
- 2012 **Maître de Conférences** à Le Mans Université, **chercheur** GAINS-TEPP.
- 2014 **Habilitation à Diriger les Recherches**
Rapporteurs : A. Guay, P. Fève, V. Mignon. Jury : F. Bec, N. Chopin, P. Fève, F. Mihoubi, A. Monfort et F. Langot (directeur d'HDR).
- 2015 **Qualification aux fonctions de Professeur des universités** (section 05).
- 2015 **MCF Hors-classe** (contingent CNU).
- 2017 **Professeur d'Économie** (1^{er} concours externe), Le Mans Université.
- 2018 **Chevalier** dans l'ordre des Palmes Académiques.

AUTRES FONCTIONS ET POSITIONS

- 1996-1998 **Chercheur à la Mission d'Analyse Économique (DARES, Ministère de l'emploi)** dans le cadre de deux contrats de recherche CEPREMAP.
- 1998-1999 **Chargé d'études à l'Observatoire Économique de la Défense** (service national).
- 2001-2003 **Chercheur au CEPII** dans le cadre d'un contrat européen.
- 2008-2012 **Chercheur au Centre d'études de l'emploi** en délégation (2008-2010) puis associé (2011-2012).
- 2009-... **Membre de la DYNARE Team (CEPREMAP)** : participation à un contrat européen, développement des filtres particuliers, développements en JULIA.

RESPONSABILITÉS PÉDAGOGIQUES

- 2001 **Responsable de la première année** de l'IUP Ingénierie Économique et Statistique (U d'Évry).
- 2002 **Habilitation** du DESS Ingénierie Économique et Statistique Appliquée (U d'Évry).
- 2003-2007 **Directeur de l'IUP** d'Ingénierie Économique et Statistique et du DESS Ingénierie Économique et Statistique Appliquée (U d'Évry).
- 2004 **Porteur du projet LMD** Ingénierie Économique et Statistique (U d'Évry).
- 2004 **Redéfinition du M1 d'Économétrie** comme année préparatoire à l'entrée en M2 Ingénierie Économique et Statistique (U d'Évry).
- 2013-... **Co-créditation et co-direction** de la Double-Licence Sciences Actuarielles et Financières (Le Mans).
- 2020 Participation au **dossier d'accréditation** de la Licence Économie-Gestion.
- 2020 Participation à la **création de la première année** de l'École d'Actuariat et Data Science du Mans (ouverte en 2021).
- 2021 Participation à la **création du Master Économie de la Santé**.
- 2021 Participation à la **création du Master Recherche APE** Théories et Évaluations des Politiques Économiques.

RESPONSABILITÉS COLLECTIVES

- 1997-2000 Responsable de **l'Informatique du laboratoire Eurequa**.
- 2002-2012 Membre de la **commission de spécialistes** (3 ans VP-MCF, U d'Évry).
- 2002-2013 Membre **extérieur de commission de spécialistes** (Dauphine, Paris-Est, Le Mans).
- 2010-2012 **Organisateur** du séminaire **et responsable** des documents de travail de l'EPEE (U d'Évry).
- 2012-2015 Membre du **conseil d'UFR**.
- 2013-2018 **Organisateur du séminaire du GAINS**.
- 2013, 2015, 2019 Membre du **comité de sélection** de l'université du Maine (section 05, mixte 05-26).
- 2015 Participation au **rapport d'auto-évaluation du GAINS** pour l'HCERES.
- 2016-2017 Membre (suppléant) du **Comité Consultatif d'Établissement** (CCE-05).
- 2016-2017 Membre de la **Commission Recherche** (MCF-HDR).
- 2016-2017 Membre de la **Section disciplinaire** compétente à l'égard des EC.
- 2016-... Membre du **Comité de pilotage** et du **Conseil d'orientation stratégique et de perfectionnement** de l'Institut du Risque et de l'Assurance.
- 2017-... Membre de la **Commission Recherche** (PR).
- 2017-2021 Membre du **Comité d'animation scientifique** du contrat PANORisk.
- 2018-2019 Membre du **Comité d'organisation** de l'école d'été 2019 de PANORisk.
- 2019-... Membre du **Comité de direction de TEPP** (FR CNRS 2042).
- 2019-... Membre du **Comité de Pilotage Recherche**.
- 2019-2020 Rédaction du **rapport d'auto-évaluation du GAINS** pour l'HCERES.
- 2021 Membre du **comité de sélection PR05** (Angers).
- 2021 **Président du comité de sélection PR05**.
- 2021 **Président du comité de sélection doctoral** (2 recrutements).
- 2021 Sélection d'un **PAST niveau PR** en Économie de la Santé.
- 2021-... Membre du **conseil d'UFR**.
- 2022-... Membre du **Comité Consultatif d'Établissement** (CCE-05).
- 2022 **Président du comité de sélection PR05**.
- 2022 Sélection d'un **PAST niveau PR** en Économie de la Santé.

ACTIVITÉS DE RECHERCHE

ARTICLES EN RÉVISION

Nonlinearities and Workers' Heterogeneity in Unemployment Dynamics, avec S. Adjemian et F. Langot, *IZA discussion papers 14822*, Institute of Labor Economics (IZA). R&R n°2 dans *Quantitative Economics* depuis octobre 2021.

La convergence de l'exposition aux risques des fonds d'investissement : le cas des mutual funds américains, avec H. Nguyen, en révision dans *la Revue Française d'Économie* depuis février 2022.

PUBLICATIONS

Limited Participation and Exchange Rate Dynamics: Does Theory Meet the Data? avec L. Patureau et T. Sopraseuth, *Journal of Economic Dynamics & Control*, **32**(4), 1041-1087, 2008. HCERES A et CNRS 1.

Impulse-Response Functions in Markov-Switching Structural VAR: a Step Further, *Economics Letters*, **106**(3), 162-165, 2010. HCERES B et CNRS 3.

An Algorithm for Generalized Impulse-Response Functions in Markov-Switching Structural VAR, *Economics Letters*, **117**(1), 230-234, 2012. HCERES B et CNRS 3.

Les fonctions de réponses impulsionnelles généralisées pour modèles VAR structurels à changements de régime markovien : une revue de la littérature Numéro spécial en l'honneur de Pierre-Yves Hénin, *Revue d'Économie Politique*, **122**(6), 851-865, 2012. HCERES B et CNRS 3.

Can Google Help Predict Youth French Unemployment? avec Y. Fondeur, *Economic Modelling*, **30**, 117-125, 2013. HCERES A et CNRS 2.

Asymmetries and Markov-Switching Structural VAR, *Journal of Economic Dynamics & Control*, **53**, 85-102, 2015. HCERES A et CNRS 1.

A Likelihood-based Approach to Estimate Nonlinear/Non Gaussian Models with Markov-Switching (with an application to MS Stochastic Volatility Models) *Special issue on risk management edited by J.M. Maheu, M. Paoletta, T.K. Siu and M.K.P. So, Econometrics & Statistics*, **8**, 204-230, 2018.

Prévisions avec les modèles à volatilité stochastique, chapitre 8 de *Méthodes de Prévisions en Finance*, édité par A. Charles, O. Darné et L. Ferrara, *Economica*, 2020.

TRAVAUX EN COURS

Particle Filtering with Dynare avec S. Adjemian, présenté dans des versions intermédiaires aux écoles d'été DYNARE (2013-2019). Contribution au projet FP7 MACFINROBODS. Présenté à la conférence de restitution du projet (Francfort, 2017), à Computational and Financial Econometrics (Londres, 2017).

Dynamic Risk-Taking Behavior of Mutual Funds, avec H. Nguyen. Présenté aux Journées ISFA-IRA (Le Mans, 2017), Computational and Financial Econometrics (Pisa, 2018) et La Semaine du Risque et de l'Incertitude (Le Mans, 2021).

Les modèles dynamiques avec variables latentes en Macroéconomie et Finance Livre en cours de rédaction.

One-step Online Maximum Likelihood for Linear State-Space Representations (avec A. Brouste), présenté aux Journées ISFA-IRA (Le Mans, 2019), Computational and Financial Econometrics (Londres, 2019) et la Conférence PANORisk (Le Mans, 2021).

One-step Online Maximum Likelihood for Markov-switching AutoRegressive Representations, avec A. Brouste et I. Votsi (LMM, U du Mans).

Réallocations d'emplois, fluctuations et productivité du travail : une analyse pour la France et les Etats-Unis, avec F. Mihoubi. Première version pour la France dans les *Documents d'études de la DARES*, 21, 1998.

Estimation du modèle de Mortensen & Pissarides par inférence simulée : une analyse pour la France et les Etats-Unis, avec F. Mihoubi. Première version pour la France dans les *Documents d'études de la DARES*, 21, 1998.

Asymmetries in the Dynamics of Aggregate Job Creation and Destruction Flows: the French and the American Manufacturing Cases, avec C. Perraudin. Seconde version dans les *Documents d'études de la DARES*, 33, 1999.

Les flux d'emplois en France : quelle intensité ? Quel impact de la démographie des établissements ? Une comparaison des estimations réalisées sur différentes sources statistiques disponibles, avec S. Le Minez et F. Mihoubi. Seconde version dans les *Documents d'études de la DARES*, 33, 1999.

EFN Report on the EURO Area Outlook, rapports pour la Commission Européenne du réseau européen EFN (coordonnés par M. Marcellino, université de Bocconi), contributions du CEPPII, mars et septembre 2002.

Nonlinear estimation with DYNARE, avec S. Adjemian, contribution du Cepremap au contrat FP7 MACFINROBODS, 2017.

Prévision de croissance, avec T. Brand et C. Doz : contribution du Cepremap au débat sur le projet de loi de finance 2020.

DYNARE: Reference Manual Version 5, avec S. Adjemian, H. Bastani, M. Juillard, F. Mihoubi, W. Mutschler, J. Pfeifer, M. Ratto, N. Rion et S. Villemot, *DYNARE working paper 72*, 2022.

PARTICIPATION À DES RÉSEAUX DE RECHERCHE, CONTRATS, CHAIRES

- 2002 Réseau **EFN** (European Forecasting Network) : contribution du CEPPII à deux rapports pour la Commission Européenne.
- 2002-2004 Membre du réseau **ESF-EMM** (European Science Foundation, Econometric Methods for the Modelling of Nonstationary Data, Policy Analysis and Forecasting).
- 2014-2016 Projet FP7 **MACFINROBODS** (contribution du CEPREMAP).
- 2014-... Co-animation du **GT Eco-Math 'Filtres'**.
- 2015-2021 Projet régional Dynamique Scientifique **PANORisk** (avec Angers, Nantes, ESSCA et Audencia).
- 2018-... Conseiller scientifique de la Chaire **Informatique et Économétrie de l'Assurance**.
- 2018 Organisation de la session '**Applications in Macroeconomics and Finance with linear and nonlinear filters**', Computational and Financial Econometrics (Pise).
- 2019 Membre du comité d'organisation de l'école d'été PANORisk '**At the frontiers of risk: method and analysis of the decision**', MSH de Nantes.
- 2019 Organisation de la session '**Advances in state-space representations: computation, estimation and applications with Julia**', Computational and Financial Econometrics (Londres).

RAPPORTS – RÉFÉRÉS

Annales d'Économie et de Statistique, Économie & Statistique, Recherches Économiques de Louvain, Revue Française d'Économie, Oxford Bulletin in Economics & Statistics, Journal of Macroeconomics, Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics.

PARTICIPATION À DES COMITÉS DE SUIVI, JURYS DE THÈSES/HDR

- 2016 Membre du jury du **Prix E. Malinvaud** de l'Association Française de Sciences Économiques.
- 2018 Présidence du **jury d'HDR** de Nicolas GROSHENNY (U. Adelaïde).
- 2020 Présidence du **jury d'HDR** de Julien ALBERTINI (Lyon 2).

DIRECTION DE THÈSES/HDR

- 2018-2021 : Nicolas Lefebvre : **Four essays in macroeconomics with heterogeneous agents**, financement Université/Région Pays de la Loire, co-encadré avec F. Langot (50%), 2018-2021 (3 ans et 3 mois). 2 articles soumis. Depuis décembre 2021 : adjoint au chef du bureau des retraites, Direction Générale du Trésor.
- 2019-... **Direction de l'HDR** de F. Maunoury (en préparation).
- 2021-... Ugo Dubois, **thèse salariée (50%)**, Banque de France.

AUTRES COMPÉTENCES

Écriture de plusieurs bibliothèques en GAUSS et JULIA.

Logiciels/langages : JULIA, GAUSS, MATLAB.

Anglais lu, écrit et parlé. Espagnol parlé.

ACTIVITÉS D'ENSEIGNEMENTS

DANS MON UNIVERSITÉ

- **Microéconomie** : cours-td, L1 Économie & Gestion (depuis 2012).
- **Calcul économique 1** : td, L1 Économie & Gestion (depuis 2014).
- **Probabilités 1** : cours et td, L2 IES (2001-2004), L2 Économie & Gestion (2011-2012). Polycopié 120p.
- **Probabilités 2** : cours-td, L2 Économie & Gestion (2010-2012).
- **Calcul économique 2** : cours-td, L2 Économie & Gestion (depuis 2015).
- **Introduction à l'économétrie** : cours et td, L2 IES puis L3 IES (2001-2008), L3 Économie & Gestion (2009), L2 Économie & Gestion (depuis 2012). Polycopié 50p.
- **Khôlles d'Économétrie** : L3 Économie & Gestion (2010-2012).
- **Économétrie 2** : cours et td, L3 Économie & Gestion (2009-2012), M1 Assurance (depuis 2012).
- **Économétrie des variables qualitatives** : cours et td, L3 Économie & Gestion, parcours Actuariat (2012-2013).
- **Économétrie des séries temporelles 1** : cours et td, L3 Économie & Gestion, parcours Actuariat (2012).
- **Économétrie des séries temporelles 2** : cours et td, M1 Assurance (2013-2016).
- **Analyse des données** : cours, M1 IES (2001-2008), M2 Assurance (2013-2020). Polycopié 130p.

- **Atelier Macroéconomie appliquée** : cours-td sur machine et suivi de projets, M1 IES (2001-2008). Polycopié 50p.
- **Économétrie de la finance** : cours et td, M1 IES (2007-2008). Polycopié 70p.
- **Économétrie appliquée** : cours-td, M1 Analyse Économique et Méthodes Quantitatives, parcours Macroéconomie Appliqué (2006-2008).
- **Économétrie pour la finance** : cours, M2 Gestion des Risques et des Actifs (2010-2012). Polycopié 200p.
- **Variables latentes** : cours, td et suivi de projets, M2 IES (2004-2008, 2010). Polycopié 100p.
- **Macroéconométrie** : cours et td, M2 Analyse Économique et Méthodes Quantitatives, spécialité Recherche Macroéconomie Appliqué (2004, 2006).
- **Le filtrage particulière** : Groupe de travail Filtres (décembre 2013).
- **Économétrie**, première année d'École d'Actuariat et Data Science (voie math) (2022- ...)
- **Statistique des Processus et Applications**, M2 Actuariat, parcours Recherche Modélisation Aléatoire Avancée, (avril 2022-...).

DANS D'AUTRES ÉTABLISSEMENTS

- **Méthodes de simulation en économétrie** : cours et td, DEA d'Économie industrielle, stratégies des ressources humaines et méthodes quantitatives, université Paris II Panthéon-Assas (2001-2004).
- **Économétrie appliquée en GAUSS** : cours-td sur machine, M2 PRO MASERATI, université Paris-Est (Créteil, 2002-2007).
- **Introduction Générale à l'Économétrie** : cours, td et encadrements de projets, Ecole Nationale des Ponts et Chaussées (Champs-sur-Marne, 2009-2010).
- **Macroéconométrie appliquée** : cours et suivi de projets, 2^{ième} année d'ENSAI (Rennes, 2009).
- **Introduction à l'économétrie** : cours et td, L3 Économie & Gestion, université Paris-Est (Marne-la-Vallée, 2010).
- **Séries temporelles multivariées sous GAUSS** : Direction des Études Économiques d'Ensemble, INSEE.
- **Formations GAUSS** (initiation et approfondissements) pour la société RITME Informatique.
- **L'estimation Bayésienne des modèles DSGE** : cours à l'École thématique de la Fédération TEPP pour l'évaluation des politiques publiques (Aussois, 2010).
- **Les modèles dynamiques avec variables latentes** : cours de formation par la recherche (ENSAI, Rennes, 2016).
- [Nonlinear Estimation with DYNARE](#), cours en ligne sur la chaîne Youtube de DYNARE (2021).