



# Gilles de Truchis

gilles.detruchis@gmail.com

## Axe de recherche

Macroéconomie internationale, finance, matières premières et économétrie financière

## Thème(s)

Econométrie des séries temporelles; Macroéconométrie

HAL: [Lien](#)

## 📌 Présentation

---

### Recherche:

Mon principal champ de recherche s'articule autour des séries temporelles avec un intérêt particulier pour la mémoire longue, la cointégration et les modèles non-linéaires appliqués à la Finance et la Macroéconomie

### Reponsabilités :

Responsable (avec C. Boucher) du [Master GDA | OMeRR](#)

### Webpage :

Retrouvez plus d'informations sur ma [page](#) personnelle

# Documents de travail

---

**HAL:** [Lien](#)

**06/2019** - Narrow-band Weighted Nonlinear Least Squares Estimation of Unbalanced Cointegration Systems

Gilles de Truchis, Elena Ivona Dumitrescu

**03/2019** - Local Whittle Analysis of Stationary Unbalanced Fractional Cointegration Systems

Gilles de Truchis, Florent Dubois, Elena Ivona Dumitrescu

**06/2017** - Testing for Extreme Volatility Transmission with Realized Volatility Measures

Christophe Boucher, Gilles de Truchis, Elena Ivona Dumitrescu, Sessi Tokpavi