



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