



# Rachidi Kotchoni

rachidi.kotchoni@gmail.com

## Axe de recherche

Macroéconomie internationale, finance, matières premières et économétrie financière

## Thème(s)

Econométrie financière; Econométrie des séries temporelles; Politique de concurrence

HAL: [Lien](#)

## Présentation

---

**Site web personnel:** <https://sites.google.com/site/rachidikotchoni/>

**Thèmes de recherche:** séries temporelles, économie financière, politique de concurrence.

**Matières enseignées:** Économétrie, Macroéconomie, Finance, Mathématiques

**Email:** rachidi.kotchoni 'at' parisnanterre.fr

## Formation

2010: Ph.D. en Économie, Université de Montréal

**Titre de la thèse:** *Estimation efficace basée sur la fonction caractéristique : théorie et applications aux données de haute fréquence*

2005: M.Sc. finance mathématique et computationnelle, Université de Montréal

2003: Ingénieur des travaux statistiques, ENEA, Dakar, SÉNÉGAL

1999: DEUG Économie, Université d'Abomey Calavi (Bénin)

## Expérience en milieu académique

2016-\_\_\_ : Maître de Conférences à l'Université de Paris Nanterre

2015-2016: Assistant Professor (African School of Economics)

Automne 2014 : Visiting Assistant Professor (Université d'Ottawa)

2013- 2014 : Enseignant-chercheur (ThÉMA, Université de Cergy-Pontoise)

2012- 2013 : Chercheur invité (Université de Montréal)

2011- 2012 : Professeur assistant visiteur (Université de l'Alberta)

2010-2011 : Stagiaire postdoctoral (CREA, Université Laval)

2007-2010 : Chargé de cours (Université de Montréal)

## Expériences non-académiques

Mai - Décembre 2005 et Mai - Août 2006 : DESJARDINS GESTION D'ACTIFS. Analyses économétriques débouchant sur des recommandations d'investissement. Classification de fonds de couverture et répliation des indices de performance par style de gestion. Modélisation non-paramétrique de la valeur à risque. Utilisation de modèles à facteurs et à changements de régime pour le choix de portefeuilles financiers.

Mai - Août 2004 : CIRANO. Analyse des options réelles dans les projets d'investissement. Évaluation de la flexibilité et de modularité dans les projets d'investissements à caractère non réversible. Simulations de Monte Carlo basées sur les arbres binomiaux.

2003: PASEC - CONFEMEN (Dakar, Sénégal) : Analyse de données d'enquête scolaire. Études thématiques sur la Guinée et le Mali. Étude de l'impact de la formation initiale des maîtres sur les performances des élèves d'écoles primaires. Identification des options de recrutement les plus efficaces.

2001: Institut National de la Statistique et de l'Analyse Économique du Bénin: Superviseur d'enquête dans une étude sur l'emploi et le secteur informel (Enquête 1-2-3). Analyse des importations de produits alimentaires au Bénin.

## Arbitrage pour journaux académiques

Canadian Journal of Statistics; Computational Statistics and Data Analysis; Journal of Financial Econometrics; Journal of Banking and Finance; Latin American Journal of Probability and Mathematical Statistics; Actualité Économique; Journal of Forecasting; Review of Industrial Organization.

## Participation à des Conférences

- 2014 European Economic Association & Econometric Society Conference. Presentations "Measuring Nonlinearity" (EEA) and "How Much Do Cartels Overcharge" (ESEM).
- Andrew Young School of Policy Studies, Georgia State University. Economics Seminars (2014). Presentation: " Probability and Severity of Recessions"
- 48<sup>th</sup>CEA meeting (2014). Presentation: "Aggregate Productivity Shocks, Zeros and Gravity"
- 2nd Summer School of the Empirical Political Economy Network (2014). Presentation: Structural Modeling (slides available upon request)
- 23rd International Conference of the International Trade and Finance Association (2013). Presentation:"Firm-level productivity shocks and Gravity"
- 46<sup>th</sup>CEA meeting (2012). Presentation: "The Econometrics of Cartel Overcharge".
- 52<sup>th</sup>meeting of the *Société canadienne de science économique* (2012). Presentation: "L'économétrie des surcharges des cartels"
- 28<sup>th</sup>meeting of the Canadian Econometrics Study Group (2011). Poster presentation: "Regularized Generalized Empirical Likelihood Estimators"
- 51<sup>th</sup>meeting of the *Société canadienne de science économique* (2011). Presentation:

- “Asymétrie, hétéroscédasticité et biais de sélection dans le modèle de gravité log-linéarisé”
- 2011 North American Summer Meeting of the Econometric Society. Presentation: “The Indirect Continuum GMM Estimation”.
  - 44<sup>th</sup> CEA meeting (2010). Présentation: “Separating the Integrated Volatility into its Latent Factors”
  - 64<sup>th</sup> European Meeting of the Econometric Society (2009). Presentation: “Assessing the Nature of Pricing Inefficiencies via Realized Measures”
  - 26<sup>th</sup> meeting of the Canadian Econometrics Study Group (2009). Poster presentation: “Assessing the Nature of Pricing Inefficiencies via Realized Measures”
  - 2009 North American Summer Meeting of the Econometric Society.
  - 43<sup>th</sup> CEA Meeting (2009). Presentation: “Assessing the Nature of Pricing Inefficiencies via Realized Measures”
  - 2008 North American Summer Meeting of the Econometric Society. Presentation: “Efficient Estimation Using the Characteristic Function”
  - 42<sup>th</sup> CEA Meeting (2008). Présentation : “Efficient Estimation Using the Characteristic Function”

# Documents de travail

---

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

06/2017 - Investor Relations' Quality and Mispricing  
Houdou Basse Mama, Rachidi Kotchoni

02/2017 - Forecasting economic activity in data-rich environment  
Rachidi Kotchoni, Maxime Leroux, Dalibor Stevanovic

02/2017 - Forecasting U.S. Recessions and Economic Activity  
Rachidi Kotchoni, Dalibor Stevanovic

# Publications

---

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

**2019** - Marcel Boyer, Anne Catherine Faye, Eric Gravel, Rachidi Kotchoni. Guiding Principles in Setting Cartel Sanctions. *Concurrences [Competition law journal / Revue des droits de la concurrence]*, 2019, 3. (hal-02573132)  
<https://hal.science/hal-02573132v1>

**2019** - Rachidi Kotchoni, Marine Carrasco. The Continuum-GMM Estimation: Theory and Application.. *International Financial Markets [Book]*, Volume 1, Taylor & Francis, 2019. (hal-02435760)  
<https://hal.science/hal-02435760v1>

**2019** - Rachidi Kotchoni, Maxime Leroux, Dalibor Stevanovic. Macroeconomic Forecast Accuracy in data-rich environment. *Journal of Applied Econometrics*, 2019, 34, pp.1050-1072. (hal-02435757)  
<https://hal.science/hal-02435757v1>

**2018** - Marcel Boyer, Anne-Catherine Faye, Eric Gravel, Rachidi Kotchoni. Challenges and Pitfalls in Cartel Fining. *Canadian Competition Law Review*, 2018, 31. (hal-01825584)  
<https://hal.science/hal-01825584v1>

**2018** - Rachidi Kotchoni. Detecting and Measuring Nonlinearity.. *Econometrics*, 2018, 6 (3), (10.3390/econometrics6030037). (hal-02435765)  
<https://hal.science/hal-02435765v1>

**2017** - Houdou Basse Mama, Rachidi Kotchoni. Investor Relations' Quality and Mispricing. 2017. (hal-04141636)  
<https://hal.science/hal-04141636v1>

**2017** - Maxime Leroux, Rachidi Kotchoni, Dalibor Stevanovic. Forecasting economic activity in data-rich environment. 2017. (hal-04141668)  
<https://hal.science/hal-04141668v1>

**2017** - Marine Carrasco, Rachidi Kotchoni. Efficient Estimation Using the Characteristic Function. *Econometric Theory*, 2017, 33 (2), pp.479-526. (10.1017/S0266466616000025). (hal-01386060)  
<https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386060v1>

**2016** - Rachidi Kotchoni, Dalibor Stevanovic. Forecasting U.S. Recessions and Economic Activity. 2016. (hal-04141569)  
<https://hal.science/hal-04141569v1>

**2015** - Marcel Boyer, Rachidi Kotchoni. How Much Do Cartels Overcharge. *Review of Industrial Organization*, 2015, 47, pp.119 - 153. (hal-01386061)  
<https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386061v1>

**2014** - Marie-Laure Allain, Marcel Boyer, Rachidi Kotchoni, Jean-Pierre Ponsard. Are Cartel Fines Optimal? Theory and Evidence From the European Union. *International Review of Law and Economics*, 2014, 42, pp.38 - 47. (hal-01386062)  
<https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386062v1>

**2014** - Marine Carrasco, Rachidi Kotchoni. Adaptive Realized Kernels. *Journal of Financial Econometrics*, 2014, 13 (4), pp.757 - 797. (10.1093/jjfinec/nbu015). (hal-01386059)  
<https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386059v1>

