

CURRICULUM-VITAE

Nom usuel : LARDIC

Prénom : Sandrine

Grade : PU

Etablissement : Université du Havre

Section CNU : 05

lardics@gmail.com

Titres Universitaires

- **HABILITATION A DIRIGER LES RECHERCHES** (Mémoire, Information, Risque)
- **DOCTORAT** (L'hystérèse en économie : théorie et mesure)

Fonction

SEPTEMBRE 2011 - PROFESSEUR DES UNIVERSITES, U. DU HAVRE

1997-2011 - MAITRE DE CONFERENCES (Université Paris Ouest Nanterre La Défense)

2005-2007 - Consultant au service Recherche de HSBC

2002-2005 - Consultant au service d'ingénierie financière de Sinopia AM

1997-2001 - Consultant à la Direction de la Recherche et de l'Innovation (DRI) du CCF

Travaux

Ouvrages

- [1] L'efficience des marchés boursiers, collection Repères, **La Découverte**, avec V. Mignon, août 2006.
- [2] Recent Developments on Exchange Rates, co-édité avec V. Mignon, **Palgrave Macmillan Press**, mars 2004.
- [3] Econométrie des séries temporelles macroéconomiques et financières. Avec V. Mignon, **Economica**, 2002.
- [4] «Long Term Memory and Chaos : a Note», ouvrage collectif, Non-linear Dynamics and Endogenous Cycles, pp. 185-201, avec G. Abraham-Frois et V. Mignon, **Springer Verlag**, 1998.

Articles parus dans des revues à comité de lecture

- [5] "Financial Ratios Analysis in Determination of Bank Performance in the German Banking Sector », avec V. Terraza, **International Journal of Economics and Financial Issues**, 2019.
- [6] « Does European primary aluminum sector is exposed to carbon leakage? New insights from rolling analysis », avec A.Boutaba, **Economics Bulletin**, 2017.
- [7] "EU Emissions Trading Scheme, competitiveness and carbon leakage: New evidence from Cement and steel industries", avec A.Boutaba, **Annals of Operations Research**, 2017.
- [8] "Permit Price Dynamics in the U.S SO2 Trading Program: A Cointegration Approach", avec A.Boutaba et O. Beaumais, **Energy Economics**, 2011.
- [9] "Can earnings forecasts be improved by taking into account the forecast bias?", **Economics Bulletin**, Vol. 7, No. 11 pp. 1-20, avec F. Dossou et K. Michalon, 2008
- [10] "Explaining the European exchange rates deviations: long memory or nonlinear adjustment ?", **Journal of International Financial Markets, Institutions and Money**, Vol. 18, pp. 207-215, avec G. Dufrénot, L. Mathieu . Mignon et A. Péguin-Feissolle), 2008.
- [11] « Earnings forecast bias—a statistical analysis », Avec K. Michalon et F. Dossou, **Banques&Marchés**, 2007.
- [12] «The Impact of Oil Prices on GDP in European Countries: An Empirical Investigation Based on Asymmetric Cointegration », avec V. Mignon, **Energy Policy**, Vol. 30, n°3, pp. 847-855, 2006
- [13] « Paradoxe de Deaton et habitudes de consommation. Une approche en termes de mémoire longue », avec V. Mignon, **Revue d'Economie Politique**, n°1, pp. 129-157, 2005.
- [14] « Estimation of fractional error correction models: a methodological note », avec V. Mignon et F. Murin, **Journal de la Société Française de Statistique**, tome 146, n°4, pp. 55-68, 2005.
- [15] « The exact maximum likelihood based-test for fractional cointegration: critical values, power and size", avec E. Dubois et V. Mignon, **Computational Economics**, Vol. 24, pp. 239-255, 2005.
- [16] « Développements récents de l'économétrie appliquée à la finance », avec V. Mignon, **Revue d'Economie Politique**, Vol. 114, n°4, 2004.
- [17] « Rational Stock Price Bubbles: Is there Any International Evidence ? », avec A. Mpachko Priso, **Finance India**, vol. XVIII, avril-mai, pp. 559-576, 2004.
- [18] « L'importance des non linéarités sur les marchés financiers », avec V. Mignon, **Revue d'Economie Politique**, Vol. 114, n°4, pp. 439-451, 2004.
- [19] « The exact maximum likelihood estimation of ARFIMA processes and model selection criteria: A Monte Carlo study », avec V. Mignon, **Economics Bulletin**, Vol. 3, n°21, pp. 1-16, 2004.

- [20] « Cointégration entre les taux de change et les fondamentaux : changement de régime ou mémoire longue ? », avec G. Dufrénot, L. Mathieu, V. Mignon et A. Péguin-Feissolle, **Revue Economique**, Vol. 55, n°3, pp. 449-458, 2004.
- [21] « Robert F. Engle et Clive W.J. Granger : Prix Nobel d'économie 2003 », avec V. Mignon, **Revue d'Economie Politique**, Vol. 114, n°1, pp. 1-15, 2004.
- [22] « Term premium and long-range dependence in volatility: A FIGARCH-M estimation on some Asian countries », avec V. Mignon, **Journal of Emerging Market Finance**, Vol. 3, n°1, pp. 1-19, 2004.
- [23] « Fractional cointegration and term structure of interest rates », avec V. Mignon, **Empirical Economics**, Vol. 29, n°4, pp.723-736, 2004.
- [24] « Fractional Cointegration between Nominal Interest Rates and Inflation: A Re-examination of the Fisher Relationship in the G7 Countries », avec V. Mignon, **Economics Bulletin**, Vol.3, n°14, pp.1-10, 2004.
- [25] « Implementing Merton's Model on the French Corporate Bond Market », avec E. Rouzeau, **Journal of Bond and Management Trading**, n°3, janvier, pp. 264-286, 2003.
- [26] « Analyse intraquotidienne de l'impact des « news » sur le marché boursier français », avec V. Mignon, **Economie Appliquée**, n°2, pp. 205-237, 2003.
- [27] « Answers about PCA Methodology on the Yield Curve », avec P. Priaulet, **Journal of Bond and Management Trading**, n°4, avril, pp. 327-349, 2003.
- [28] « Cointégration fractionnaire entre la consommation et le revenu », avec V. Mignon, **Economie et Prévision**, n°258, pp.123-142, 2003.
- [29] « Comportement du marché lors des révisions de la composition du CAC 40 », avec M. Boussema, **Banque & Marchés**, mars-avril, n°63, pp. 5-21, 2003.
- [30] « Un modèle multifactoriel des spreads de crédit : Estimation sur panels complets et incomplets », avec C. Gauthier, **Economie et Prévision**, n° 159, pp. 53-70, 2003.
- [31] « Etude d'événements sur données intraquotidiennes françaises : les réactions des actionnaires aux annonces », avec V. Mignon, **Revue d'Economie Financière**, n°66, pp. 335-340, 2003.
- [32] « La mémoire longue en économie : une revue de la littérature », avec V. Mignon, **Journal de la Société Française de Statistiques**, pp. 5-48, 2001.
- [33] « Application du Modèle multifactoriel aux spreads de crédit français », avec C. Gauthier, **Banque et Marchés**, Nov-Déc. 2000.
- [34] « CAPM, APT et mesures de performance : une présentation synthétique », **Revue de l'AFPEN**, n°10, septembre 1999.
- [35] « Modélisation bayésienne vectorielle autorégressive », avec A. Mpacko Priso, **Economie et Prévision**, n°4, 1999.
- [36] « Modélisation FIGARCH appliquée à l'analyse de la structure par terme des taux d'intérêt », avec V. Mignon, **Finance**, vol. 20, pp. 91-114, 1999.
- [37] « Prévision ARFIMA des taux de change: les modélisateurs doivent-ils encore exhorter à la naïveté des prévisions? », avec V. Mignon, **Annales d'Economie et de Statistiques**, mai-juillet, n°54, pp. 47-68, 1999.
- [38] « Essai de mesure du 'degré' de mémoire longue des séries. L'exemple de la modélisation ARFIMA », avec V. Mignon, **Economie Appliquée**, n°2, pp. 161-195, 1997.
- [39] « L'analyse bayésienne peut-elle inciter les experts à réviser le mode de formation de leurs anticipations? », avec A. Mpacko Priso, **Journal de la Société Statistique de Paris**, 1996.
- [40] « Les tests de mémoire longue appartiennent-ils au camp du démon? », avec V. Mignon, **Revue Economique**, vol. 47, n°3, pp. 531-540, 1996.
- [41] « Non-stationnarité, mémoire des séries et hystérésis », **Revue d'Economie Politique**, 1996.

Divers

- 2012 – Organisation d'une journée d'étude en Econométrie Appliquée, 22 juin, Université du Havre.
- 2002-2014 Co-organisation d'une journée d'étude annuelle à l'université de Paris Ouest Nanterre La Défense «Les développements récents de l'économétrie appliquée à la finance».
- 2010 - Expert nommée par le collectif Andromède (conseil consultatif régional pour l'enseignement supérieur, la recherche et la valorisation de Provence Alpes Côte d'Azur)
- 2007 - Membre du Jury du concours d'entrée à l'ENS Cachan (section D2).
- 2004 - Co-responsable du numéro spécial « Non-linéarités sur les marchés financiers », n°4, Revue d'Economie Politique, juillet-août.
- 2004 - Co-responsable du comité scientifique du colloque international Econométrie des Valeurs Boursières, AEA, Paris, 1-2 avril.
- 2003 - Responsable scientifique d'une journée d'étude sur les thèmes du risque de crédit et des prévisions de bénéfices, dans le cadre du bureau Finance-Assurance de la Société Française de Statistiques, Institut Henry Poincaré, 4 novembre.
- 2003 - Co-responsable du comité scientifique du colloque sur les taux de change, avec l'Association d'Econométrie Appliquée (AEA), Marseille, 6&7 mars.
- 2001 - Participation au projet de recherche « Vers une convergence des systèmes de gouvernement d'entreprise en Europe », sous la direction de M. Boutillier, pour le compte du Commissariat Général au Plan, décembre.