

# Curriculum Vitae

Yannick LE PEN

October 25, 2010

Né le 02/10/65 à Saint-Cyr l'école (78)  
Nationalité française, célibataire

## Situation professionnelle

---

Depuis septembre 2010 : Maître de conférences à l'université de Paris-Dauphine. Chercheur au LEDA-CEGMP.

1996 à 2010 : Maître de conférences à l'université de Nantes. Chercheur au LEMNA (Université de Nantes)

## Adresse professionnelle

---

Université de Paris-Dauphine  
Place du Maréchal de Lattre de Tassigny  
75775 Paris cedex 16

email : [yannick.le\\_pen@dauphine.fr](mailto:yannick.le_pen@dauphine.fr)

homepage : <http://sites.google.com/site/yannicklepen/>

## Formation

---

1999 : Habilitation à Diriger des Recherches - soutenue le 2 juillet à l'Université de Nantes

Jury : J.-C. Berthélemy, J. Glachant, J.-P. Gourlaouen, J.-P. Laffargue, H. Noguès, C. Tavera.

1996 : Doctorat en Sciences Economiques - soutenue le 4 janvier à l'Université de Paris I

Titre de la thèse : " Convergence des richesses des nations : une approche empirique "

Jury : G. Abraham-Frois, D. Cohen, C. Gourieroux, J.-P. Laffargue, A.Varoudakis.

Mention très honorable et félicitations du jury à l'unanimité - proposition pour un prix de thèse et une subvention pour publication.

1991 : D.E.A. d'Economie Mathématique et d'Econométrie, Université de Paris I, mention AB.  
Magistère d'Economie, Université de Paris I, mention AB.

## Activités de recherche

---

### Articles publiés

- [8] “Volatility transmission and volatility impulse response functions in European electricity forward markets”, avec Benoît Sévi, *Energy Economics*, vol 32(4), 2010, p. 758-770.
- [7] “What trends in energy efficiencies? Evidence from a robust test”, avec Benoît Sévi, *Energy Economics*, vol 32(3), 2010, p. 702-708.
- [6] “Impact d’un choc sur les corrélations de trois indices boursiers - La faillite de Lehman Brothers”, avec Benoît Sévi, *Revue Economique*, vol 61(3), 2010, p. 407-419.
- [5] “On the non-convergence of energy intensities: evidence from a pair-wise econometric approach”, avec Benoît Sévi, *Ecological Economics*, vol 69(3), 2010, p. 641-650.
- [4] “Convergence among four industrialised countries (1870-1994): results from a time varying co-integration approach ”, *Empirical Economics*, vol 30, 2005, p. 23-35.
- [3] “On modelling convergence clubs ” avec Patrick Fève, *Applied Economics letters*, vol 7(5), 2000, p. 311-314.
- [2] “Convergence des revenus par tête : un tour d’horizon ”, *Revue d’Economie Politique*, vol 107(6), 1997, p. 715-756.
- [1] “Les épisodes de la convergence européenne ” avec Pierre-Yves Hénin, *Revue Economique*, vol 46(3), 1995, p. 667-677.

### Documents de travail

2010 : “Revisiting the excess co-movements of commodity prices in a data-rich environment”, avec Benoît Sévi.

2009 :

“A pair-wise approach to output convergence between European regions”, en révision pour *Economic Modelling*

“News and correlation: an impulse response analysis”, avec Benoît Sévi.

“Option market and volatility in the EU ETS” avec Julien Chevallier et Benoît Sévi, en révision dans *Resource and Energy Economics*

“The relationship between gas and oil prices: a spillover index approach” avec Benoît Sévi.

2007 : “Optimal hedging in European electricity forward markets ”, avec Benoît Sévi.

2002 : “An International Comparison of Health Care Expenditure ”, avec Catherine Bac.

Mise à jour : October 25, 2010

## Encadrement de thèse

Myriam Nourry, “Essais empiriques sur la relation entre Croissance et Environnement”, avec le Professeur Dorothee Brécard, thèse soutenue en novembre 2009 à l’Université de Nantes. Recrutée comme Maître de Conférences à l’Université de Brest.

Sondès Kahouli, “Essais empiriques sur la transition énergétique”, avec le Professeur Dorothee Brécard. thèse soutenue en septembre 2010 à l’Université de Nantes. En post-doc à l’IFP.

## Communications à des colloques

---

2010 : 59<sup>ème</sup> Congrès de l’AFSE, “Revisiting the excess co-movements of commodity prices in a data-rich environment”, septembre 2010.

Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics 18<sup>th</sup> Annual Symposium, University of Piemonte Orientale, 1-2 april, “News and correlations: an impulse response analysis”.

3<sup>ème</sup> Journée de l’Atelier Finance et Risque, Université de Nantes, 12 mars, “Revisiting the excess co-movements of commodity prices in a data-rich environment”.

2009 : Forecasting Financial Markets, XVI<sup>th</sup> international conference, Luxembourg, 27-29 may, “News and correlations: an impulse response analysis”.

32nd IAEE International Conference, San Francisco, 22-24 juin, “Option market and volatility in the EU ETS”.

AERE Conference, Amsterdam, juin, “Option market and volatility in the EU ETS”, présenté par Benoit Sévi.

58<sup>ème</sup> Congrès de l’AFSE, Université Paris Ouest Nanterre La Défense, 10-11 septembre, “News and correlations : an impulse response analysis”.

8<sup>ème</sup> Journée d’économétrie “Développement récents de l’économétrie appliquée à la finance”, Université Paris Ouest Nanterre La Défense, 26 Novembre, “News and correlations: an impulse response analysis”.

2008 : 7<sup>ème</sup> Journée d’économétrie “Développement récents de l’économétrie appliquée à la finance”, Université Paris Ouest Nanterre La Défense, 26 Novembre, “Volatility transmission and volatility impulse response function in European forward electricity market”, session poster.

Séminaire Finance, Centre d’économie de la Sorbonne, Université Paris I Panthéon-Sorbonne, 15 octobre, “Volatility transmission and volatility impulse response function in European forward electricity market.”

57<sup>ème</sup> Congrès de l’AFSE, Paris, 18-19 septembre, “Volatility transmission and volatility impulse response function in European forward electricity market.”

“Policy-making Benefits and Limitations from Using Financial Methods and Modelling in Electricity Markets,” international workshop organized by UKERC, St Anne’s College, Oxford, UK, 9-10 july, “Volatility transmission and volatility impulse response function in European forward electricity market.”

Mise à jour : October 25, 2010

31<sup>st</sup> IAEE International Conference, Istanbul, 18-20 july, "Volatility transmission and volatility impulse response function in European forward electricity market" et "Convergence in energy efficiencies."

2007 : 9<sup>th</sup> IAEE European Energy Conference, juin, Florence, " Optimal hedging in European electricity forward markets ", en collaboration avec Benoît Sévi.

6<sup>th</sup> IDEI LERNA Conference on Environment and resource economics, mai, Toulouse, " Optimal hedging in European electricity forward markets ", en collaboration avec Benoît Sévi.

2002 : The 10<sup>th</sup> International Conference in Panel Data, Berlin, " An International Comparison of Health Care Expenditure ", en collaboration avec Catherine Bac.

2000 : Colloque Théories et Méthodes de la Macroéconomie, Nanterre, " Convergence Among Four Industrialised Countries (1870-1994) : Results from a Time Varying Co-Integration Approach ".

1997 : Atelier Modélisation Macroéconométrique Dynamique organisé par le CREST, L'EPEE (Université d'Evry-Val d'Essone) et le M.A.D. (Université de Paris I) à Evry - " Estimating a Conditional Convergence Equation from a Dynamic Heterogenous Panel Data Model".

1996 : Congrès de l'A.F.S.E. à Paris - " Convergence des Pays de l'O.C.D.E. de 1950 à 1988 : une approche en terme de séries temporelles ".

1996 : E.S.E.M. à Istanbul - " Estimating a Conditional Convergence Equation from a Dynamic Heterogenous Panel Data Model ".

Colloque Théories et Méthodes de la Macroéconomie à Paris - "Convergence des Pays de l'O.C.D.E. de 1950 à 1988 : une approche en terme de séries temporelles ".

1994 : Congrès de l'A.F.S.E. à Paris - " Les Episodes de la Convergence Européenne ".

## Referee

Energy Economics, Empirical Economics, Ecological Economics, Economie et Prévision, Annales d'économie et de statistiques, Journal of Applied Economics, Energy policy, Revue d'Economie Politique.

## Contrats de recherche

2010 : Participation au contrat sur la finance Carbone, financé par le Conseil Français de l'énergie.

2009/2010 : Participation au contrat ANR Plan de Déplacement Urbain (tâche 5, coordonnée par le professeur Dorothée Brécard)

2006-07 : Participation au contrat de recherche SHS avec la Région Pays-de-Loire (volet 1 du contrat : convergence des régions européennes)

## Autres

Organisation de la troisième journée de l'Atelier Finance et Risque, 12 mars 2010.

Mise à jour : October 25, 2010

Février & juin 2010 : Séjour de recherche à la London Business School, Energy Markets Group, à l'invitation du Professeur Derek Bunn.

## Activités d'enseignement

---

Econométrie des rendements, M2 Ingénierie financière, Université Paris-Dauphine.

Statistique, Licence 3, Université de Paris-Dauphine.

Econométrie, M1, Université de Paris-Dauphine.

Théorie de la croissance, Master 1ère année Economie du développement durable, Université de Nantes (2005 à 2009)

Economie Internationale, Licence Science économique, 3ème année, Université de Nantes (2005 à 2009)

Principles of Macroeconomics, cours en anglais, dans le cadre d'un partenariat entre l'Université de Nantes et Bentley College, (Waltham, Massachussets, USA)( 2006 à 2009)

Statistique : D.E.U.G. " Economie et gestion " (première année), Université de Nantes (2000 à 2004).

Macroéconomie : D.E.U.G. " Economie et gestion " (deuxième année), Université de Nantes.

Economie européenne : D.E.U.G. " Economie et gestion " (deuxième année), Université de Nantes.

Calcul économique : maîtrise " Analyse et politique économiques ", Université de Nantes.

Econométrie : maîtrise M.A.S.S., Université de La Rochelle.

Econométrie des séries temporelles : M2, Université de Nantes.

Théorie de la croissance, chargé de cours à l'ENSAI, Rennes, en 2008/09/10.

Macroéconomie ouverte : troisième année (niveau maîtrise), Institut Universitaire Professionnalisé Banque Finance, Université de Nantes.

Encadrement de projets en Macroéconométrie à l'E.N.S.A.I. (Rennes).

## Divers

---

Université de Nantes :

Responsable pédagogique de la troisième année de licence économie : 2007/08, 2008/09, 2009/10.

Responsable pédagogique Master "Economie et gestion du développement durable" : 2004/05, 2005/06.

Responsable pédagogique de la deuxième année de DEUG Science économique : 2000/01 à 2003/04.

Membre du Conseil scientifique de l'Université de Nantes de 1999 à 2003

Membre du Conseil scientifique de l'IEMN-IAE de 2008 à 2010.

Membre du Conseil de laboratoire du LEMNA de 2008 à 2010.

Mise à jour : October 25, 2010