

## Karamé Frédéric

Professeur d'Économie

Faculté de Droit, Sciences Economiques et de Gestion  
Avenue Olivier Messiaen, 72085 Le Mans Cedex

frederic.karame@univ-lemans.fr

Site web : <http://f.karame.free.fr>



### THEMES DE RECHERCHE

---

- Méthodes quantitatives appliquées à la macroéconomie et la finance, économétrie linéaire et non linéaire des séries temporelles, méthodes de résolution des modèles DSGE, modèles à composantes inobservables, inférence simulée, filtrage particulière, économétrie bayésienne.

### PUBLICATIONS

---

Limited Participation and Exchange Rate Dynamics: Does Theory Meet the Data? avec L. Patureau (université Paris-Dauphine) et T. Sopraseuth (université de Cergy-Pontoise), *Journal of Economic Dynamics & Control*, **32**(4), 1041-1087, 2008.

Impulse-Response Functions in Markov-Switching Structural VAR: a Step Further, *Economics Letters*, **106**(3), 162-165, 2010.

An Algorithm for Generalized Impulse-Response Functions in Markov-Switching Structural VAR, *Economics Letters*, **117**(1), 230-234, 2012.

Les fonctions de réponses impulsionnelles généralisées pour modèles VAR structurels à changements de régime markovien : une revue de la littérature, Numéro spécial en l'honneur de Pierre-Yves Hénin, *Revue d'Économie Politique*, **122**(6), 851-865, 2012.

**Can Google Help Predict Youth French Unemployment?** avec Y. Fondeur (Cee), *Economic Modelling*, **30**, 117-125, 2013.

Asymmetries and Markov-Switching Structural VAR, *Journal of Economic Dynamics & Control*, **53**, 85-102, 2015.

### OUVRAGES OU CHAPITRES D'OUVRAGES

---

Prévisions avec les modèles à volatilité stochastique, chapitre 11 dans *Prévisions en Finance*, édité par A. Charles, O. Darné et L. Ferrara, à paraître.

## COMMUNICATIONS, COLLOQUES ET CONFERENCES

---

**A Likelihood-based Approach to Estimate Nonlinear/Non Gaussian Models with Markov-Switching** (with an application to MS Stochastic Volatility Models), présenté au séminaire de l'EPEE (Evry, mars 2012), du GAINS (Le Mans, mars 2012), au séminaire Eco & Maths (Le Mans, décembre 2012), à Computational and Financial Econometrics (Oviedo, décembre 2012), T2M (Lyon, mars 2013), à la 3<sup>ème</sup> journée ISFA-IRA (Le Mans, novembre 2013), au Groupe de travail Filtres (Le Mans, décembre 2013), à l'ISCEF (Paris, avril 2014) et dans sa version actuelle à la 4<sup>ème</sup> journée ISFA-IRA (Lyon, octobre 2014), au séminaire BiP (ENSAE, novembre 2014), à Computational and Financial Econometrics (Pise, décembre 2014), à la conférence Panorisk (Angers, novembre 2017). En révision à Econometrics & Statistics (depuis août 2017).

**Particle Filtering with Dynare** (avec S. Adjemian, Le Mans université et Cepremap), présenté dans des versions intermédiaires aux écoles d'été DYNARE (2013-2016). Contribution au projet FP7 MACFINROBODS. Présenté à la conférence de restitution du projet (Francfort, avril 2017), à Computational and Financial Econometrics (Londres, décembre 2017).

**Nonlinearities in Unemployment** (avec S. Adjemian et F. Langot, Le Mans université et Cepremap), présenté à T2M (Lisbonne, mars 2017).

**New Estimation Methods for Models with Occasionally Binding Constraints**, présenté à la conférence inaugurale PANORISK (Le Mans, juin 2016).

## RESPONSABILITES PEDAGOGIQUES ET ADMINISTRATIVES

---

- 2013-... Création et co-direction de la Double-Licence Sciences Actuarielles et Financières (Le Mans).
- 2013-.... Organisateur du séminaire du GAINS.
- 2016-... Membre (suppléant) du Comité Consultatif d'Établissement (CCE-05).
- 2016-... Membre du Conseil de laboratoire GAINS.
- 2016-... Membre du comité de pilotage de l'Institut du Risque et de l'Assurance du Mans.
- 2016- Participation et animation du GT Filtres (IRA, Le Mans université).

## ENSEIGNEMENTS

---

- **Microéconomie** : CMTD, L1 Economie & Gestion (depuis 2012).
- **Calcul économique 1** : TD, L1 Economie & Gestion (depuis 2014).
- **Calcul économique 2** : CM, L2 Economie & Gestion (depuis 2015).
- **Introduction à l'économétrie** : CM et TD, L2 Economie & Gestion (depuis 2012).
- **Econométrie des séries temporelles 2** : CM et TD, M1 Monnaie, Banque, Finance & Assurance (2013-2016, 2017).
- **Analyse des données** : CM, M2 Monnaie, Banque, Finance & Assurance (depuis 2013).