



Florian Pelgrin, PhD

Département de Science des données, Economie et Finance

Professeur Permanent (full) – Spécialités : Economie &
Finance & Econométrie

Tél.: + 33 (0)3 20 15 45 25

Fax: + 33 (0)3 20 15 45 01

E-mail : florian.pelgrin@edhec.edu

Florian Pelgrin est diplômé de l'ENSAE et a obtenu son doctorat en sciences économiques de l'Université de Paris I – Panthéon Sorbonne.

Avant de rejoindre l'EDHEC, Florian Pelgrin a été professeur assistant à l'Université de Lausanne (faculté des HEC) au sein du département des sciences économiques. Par ailleurs, Florian Pelgrin a travaillé à l'O.C.D.E, l'O.F.C.E. et la Banque du Canada. Il est chercheur affilié au Cirano et membre du bureau scientifique de l'institut Louis Bachelier. Il a été également conseiller scientifique auprès de la Banque de France.

Ses thèmes de recherche s'articulent autour de la théorie des cycles économiques, la politique monétaire et la dynamique de l'inflation, l'émergence des fluctuations endogènes dans les modèles multisectoriels, la macro-économétrie et l'économie de la santé dans les modèles de cycle de vie.

Ses papiers ont été publiés dans *Review of Economic Studies*, *Journal of Monetary Economics*, *Journal of Economic Dynamics and Control*, *Journal of Econometrics*, *Econometric Reviews*, *Economic Journal*, *European Economic Review*, *Economic Letters*, *Statistics and Probability Letters*, *Journal of Health Economics*, *Health Economics*, *Journal of Mathematical Economics*.

EDUCATION

- 2005 **PhD, Economie et Econométrie**, Université de Paris I Panthéon-Sorbonne,
Essais sur la dynamique de l'inflation, Juin 2005
- 1999 **Diplômé de l'E.N.S.A.E.** (Ecole Nationale de la Statistique et de
l'Administration Economique)
- 1998 **Maîtrise en Statistiques et Processus Empiriques**, Université de Paris VI
- 1996 **Maitrise en Economie**, Université de Paris I (Macroéconomie, Modélisation et
Conjoncture)
Maîtrise en Economie, Université de Nice-Sophia Antipolis (Organisation
Industrielle et Dynamique Economique)

PUBLICATIONS

A venir

“Medium term endogenous fluctuations in three-sector optimal growth models”, avec K. Nishimura and A. Venditti.

Articles acceptés/publiés

“Structural VAR Models in the Frequency Domain”, avec A. Guay, *Journal of Econometrics*, A paraître.

“Soccer Labour Market Equilibrium and Efficient Training of Talents”, avec Marnix Amand, Arnaud Cheron, et Anthony Terriau, *European Economic Review*, A paraître.

“On the long-run fluctuations of inheritance in two-sector OLG models”, avec Alain Venditti, *Journal of Mathematical Economics*, vol. 101. Août 2022.

“Valuing Life as an Asset, as a Statistic, and at Gunpoint”, avec Julien Hugonnier et Pascal St-Amour, *The Economic Journal*, vol. 132, Avril 2021, pp. 1095-112.

“Closing Down the Shop: Optimal Wealth and Health Dynamics near the end of life”, avec Julien Hugonnier et Pascal St-Amour, *Health Economics*, Vol. 29, Janvier 2020, pp. 138 - 153

“Parametric Inference of Autoregressive Heteroscedastic Models with error in variables”, avec Salima El-Kolei, *Statistics and Probability Letters*, vol. 130, Novembre 2017, 63-70.

“Life Cycle Responses to Health Insurance Status”, with Pascal St-Amour, *Journal of Health Economics*, vol. 49, September 2016, 76-96.

"Using Implied Probabilities to Improve Estimation with Unconditional Moment Restrictions", avec Alain Guay, *Econometrics Review*, 2016, vol. 35(3), 344-372.

"Estimating Aggregate Autoregressive Processes when only Macro Data are available", avec Eric Jondeau, *Economics Letters*, 2014, vol. 124, 341-347.

"Health and (Other) Asset Holdings", avec Julien Hugonnier et Pascal St-Amour, *Review of Economic Studies*, 2013, vol. 80(2), 663-710.

"Sectoral Phillips Curves and the Aggregate Phillips Curve", avec Jean Imbs et Eric Jondeau, *Journal of Monetary Economics*, 2011, 58(4-5).

"Time Consistent Control in Non-Linear models", avec Steve Ambler, *Journal of Economic Dynamics and Control*, 2010, vol. 34(10), 2215-2228.

"National Saving-Investment Dynamics and International Capital Mobility", avec Sebastian Schich, *Journal of international Money and Finance*, 2008, vol. 27(3), 331-344.

"Un Regard Bayésien sur les Modèles Dynamiques de la Macroéconomie", avec Stéphane Adjemian, *Economie et Prévisions*, 2008, 83-184, vol. 2/3.

"Bayesian Inference and State Number Determination for Hidden Markov Models : An Application to the Information Content of the Yield Curve about Inflation", avec Nicolas Chopin, *Journal of Econometrics*, 2005, vol. 123(2), 327-344.

Others

"The Decline in Private Saving Rates in the 1990s in the OECD Countries : How much can be explained by non-wealth fundamentals ?", avec Alain DeSerres, *OECD Economic Studies*, 2003(36).

"Introduction aux modèles espace-état et au filtre de Kalman", avec Matthieu Lemoine, *Revue OFCE*, 2003, vol. 23, 203-229.

"Financial Development and Investment : Panel Data Evidence for OECD Countries", avec Sebastian Schich, *Applied Economic Letters*, 2002, vol. 9(1), 1-7.

"Projection de trajectoires économiques par microsimulation : Quelle équité pour les retraites ?", avec Alexis Dantec et Emmanuelle Nauze-Fichet, *Revue Economique*, 2000, vol. 51(1), 115-129.

Affiliations de recherche

- CIRANO (Centre Interuniversitaire de Recherche en ANalyse des Organisations).
- Institut Louis Bachelier : Membre du bureau scientifique
- Chaire en macroéconomie et prévisions (UQAM) : Chercheur

FONDS DE RECHERCHE

Structural Bayesian VAR models and inflation forecasts, Banque de France, 2021-2022.

Value of life (avec Pascal St-Amour), Institut Europlace de Finance (EIF) et le Labex Louis Bachelier (10 000 euros), Juin 2018.

Risk-based Portfolio Strategies and Estimation Risk (with Christophe Hurlin), Institut Europlace de Finance (EIF) et le Labex Louis Bachelier (10 000 euros), Décembre 2017.

A Macro-finance Model of the Term Structure with Time-varying Market Prices of Risk (with René Garcia and Eric Jondeau), Institut Europlace de Finance (EIF) et le Labex Louis Bachelier (10 000 euros, principal adviser), Décembre 2014.

Financial and Health-Related Allocations over the Life Cycle, avec Julien Hugonnier et Pascal St-Amour, Swiss Finance Institute, 2013 - 2016.

Modeling asymmetric and leptokurtic distributions in health economics, Swiss National Fund of Research, 168,877 CHF (2010-2013).

Health and portfolio decisions, Swiss National Fund of Research, 44,763 CHF (2008-2009).

Financial support of the Swiss National Fund of Research through the project "Financial Valuation and Risk Management".

EXPERIENCE en tant que PROFESSEUR

09/2013 – Présent **Professeur**, Edhec Business School, France

Champs d'enseignement : Macroéconomie, Finance (méthodes empiriques en Finance et Econométrie de la finance), Econométrie et Statistiques (apprentissage statistique supervisé, modèles statistiques avancés), et méthodologie de la recherche.

Créateur et Directeur du MSc Data Analytics & Artificial Intelligence (Sept. 2017 – Sept 2020)

- ✓ Elaboration, création et supervision du programme
- ✓ Développement des partenariats : Le Wagon, Openclassrooms et Matrice/Ecole 42
- ✓ Coordination, supervision et gestion des cours
- ✓ Organisation des séminaires et des lectures des invités
- ✓ Communication et marketing du program.

Coordinateur des méthodes quantitatives (A l'EDHEC et en partenariat avec l'Université Côte d'Azur, UCA)

- ✓ Coordination, supervision et gestion de l'ensemble des cours de méthodes quantitatives en Premaster (Bachelor, 3^{ème} année), la maîtrise « Business Management » (1^{ère} année, Lille) et la maîtrise en économie financière (1^{ère} année, MSc en ingénierie financière)
- ✓ Création et supervision du double diplôme Maîtrise en Finance (EDHEC) & Mathématiques appliquées (UCA, Département de mathématiques)
- ✓ Membre du comité scientifique du MoDSU (Maîtrise en Science des données, UCA)

Certificat FinTech (Sciences des données en Finance) et certificat Bloomberg

- ✓ Elaboration et supervision des cours (2015 – 2020): Data & Machine learning, Python for Finance, Data Viz, Big Data Applications for Financial markets

- 09/2020–06/2021 **Professeur invité**, UQAM, Université du Québec à Montréal. Cours du programme doctoral : Données massives et apprentissage automatique avec applications en économie (avec D. Stevanovic)
- 09/2013–06/2019 **Professeur invité**, EPFL, Ecole Polytechnique Fédérale de Lausanne
Cours: Financial econometrics (avec des applications de données massives), maîtrise en ingénierie financière (1ère année).
- 09/2005– 08/2013 **Professeur assistant**, Université de Lausanne – Faculté des HEC
Maîtrise : Politique monétaire, Séries temporelles appliquées (en Finance et en Economics), Econométrie financière avancée, Economie de la santé, séminaire en macroéconomie
Licence : Econométrie II
- 09/2011– 02/2015 **Professeur invité**, Université Côte d’Azur, Département de mathématiques (Laboratoire J. Dieudonné)
Maîtrise : Econométrie financière, analyse des séries temporelles.
- 09/2008–09/2012 **E.N.S.A.E.**
Maîtrise: Analyse des series temporelles linéaires.

Autres expériences

Banque de France (depuis January 2017) :

- Cours/Séminaires sur l’apprentissage statistique ;
- Cours/Séminaires sur l’économétrie Bayésienne
- Cours/séminaires sur la modélisation de l’inflation à partir des modèles vectoriels autorégressifs Bayésiens.

O.C.D.E., trois cours: Introduction à l’économétrie, Econométrie des panels et macro-économétrie structurelle.