

Dies Academicus 2005

Laudatio de Monsieur Christian Gouriéroux, Docteur honoris causa Faculté des sciences économiques

En proposant à l'Université de conférer le titre de docteur honoris causa à Christian Gouriéroux, la Faculté des sciences économiques souhaite lui manifester sa reconnaissance tant sur le plan scientifique que sur le plan humain et pour son importante contribution à l'étude statistique des données financières.

Le professeur Christian Gouriéroux est agrégé de mathématique et titulaire d'un Diplôme d'études approfondies de l'Université Pierre et Marie Curie. Il est également diplômé de l'Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economique. En 1982, il soutient une thèse d'Etat à l'Université de Rouen sur les Modèles à variables dépendantes limitées. En 1972, il est assistant de recherche à l'Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economique, de 1974 à 1976, professeur de mathématique à l'Ecole des Travaux Publics d'Abidjan, de 1976 à 1985, professeur assistant à l'Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economiques, enfin, de 1985-1988, professeur à l'Université des Sciences et Technologies de Lille. En 1988, Christian Gouriéroux revient à Paris. Nommé professeur à l'Université Paris Dauphine, il dirige jusqu'en 1993 le Centre de Recherche en Economie et Statistique, un des meilleurs centres de recherche mondiaux du domaine. Depuis 1994, il dirige le laboratoire de Finance et Assurance du Centre de Recherche en Economie et Statistique. En 2001, il devient également professeur à l'Université de Toronto.

Chronologiquement, ses contributions théoriques ont porté sur les anticipations rationnelles, les méthodes d'inférence statistique telles le « pseudo-maximum de vraisemblance » et « l'inférence indirecte » et les séries temporelles. Depuis le milieu des années quatre-vingt-dix, finance et assurance sont ses domaines de prédilection : finance de marché, surveillance des risques, sélection de clientèle pour le crédit aux particuliers, structure par terme des taux d'intérêt et risque de crédit. J'arrêterai là cette énumération qui met en évidence l'importance des enjeux et la diversité des domaines auxquels Christian Gouriéroux s'est intéressé jusqu'à présent.

Comment faire brièvement état des travaux de Christian Gouriéroux autrement que par des statistiques ? Il a publié 18 livres principalement dans le domaine de séries temporelles, de l'économétrie de la finance et de l'assurance, mais aussi en théorie des sondages et en modélisation de variables qualitatives. Christian Gouriéroux a également publié 168 articles dont 12 dans la prestigieuse revue *Econometrica*. Il faut mentionner ici le nom d'Alain Monfort, professeur à l'Ecole Polytechnique de Paris et à l'Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economiques avec lequel il a co-rédigé cinq ouvrages et plus 52 articles scientifiques au cours des vingt-cinq dernières années. Christian Gouriéroux assure une importante activité d'enseignement et de direction de thèses. Il a encadré à ce jour 19 thèses de doctorat.

Christian Gouriéroux connaît également bien la Suisse. Depuis 1995, il a participé à plusieurs reprises au 3e cycle romand en gestion d'entreprise en tant que conférencier invité. Il a enseigné dans le programme doctoral FAME. Depuis 2002, il est membre du comité scientifique du National Center of Competence Research

(NCCR) Finrisk. Depuis 2000, il enseigne dans le postgrade en statistique de notre Université où il partage ses connaissances et son expérience avec enthousiasme. Enfin, en 2001, il m'a fait l'honneur de participer, comme membre du jury, à la soutenance d'une thèse dont j'assurai la direction.

Son rayonnement scientifique est immense. Il est éditeur associé d'une dizaine de journaux scientifiques dont *Econometrica*, *Economic Theory* et la *Review of Economic Studies*. Il a également obtenu de nombreuses distinctions honorifiques. Citons en quelques-unes : Docteur Honoris Causa de l'Université de Mons-Hainaut, Médaille d'argent du Centre National de la Recherche Scientifique, médaille d'or de la société française de statistique, prix Koopman en théorie économétrique, 'grand conférencier' de l'Université de Montréal.

Son prestigieux curriculum vitae ne fait pas de Christian Gouriéroux une personne enfermée dans ses recherches. Homme d'esprit, ouvert sur le monde, volontiers espiègle, c'est un amateur très avisé d'art africain.