



**BUSINESS & ECONOMIC
STATISTICS MODELING
LABORATORY**

**RAPPORT FINAL
D'ACTIVITE**

2000- 2003

**Université de Tunis
Institut Supérieur de Gestion de Tunis**

S O M M A I R E

1. Présentation générale et Objectifs de BESTMOD	3
2. Vocation du BESTMOD	5
3. Retombées socio-economiques	5
4. L'assistance à la recherche	7
5. Organisation Générale du BESTMOD	8
5.1 Directeur du Laboratoire	8
5.2 Personnel Scientifique	9
5.2.1 Composition du L.R de l'année 2002-2003	9
5.2.2 Les nouveaux membres du L.R de l'année 2003	13
5.3 Visiteurs et séminaires avec partenaires du BESTMOD (2000-2003)	15
6. Sujets de recherches du BESTMOD	17
7. Réalisations (2000-2003)	18
7.1 Séminaire de recherche hebdomadaire	18
7.2 Diplômes obtenus et passages de grades (2000-2003)	19
7.3 Production scientifique	21
7.3.1 Publications	21
7.3.2 Working Papers 1999-2003	30
7.3.3 Livres publiés	33
7.3.4 Livres en cours	33
8. Perspectives	33
9. Tableau récapitulatif des productions scientifiques	35
10. Bilan des dépenses	36
11. Annexes : Synthèse et résultats des travaux de recherche	38
Annexe 1 : Travaux de recherche en Thèse	38
Annexe 2 : Travaux de recherche en DEA	74

1. Présentation générale et objectifs de BESTMOD

Ce rapport a pour objectif de présenter le **BESTMOD** et ses activités durant la période 2000-2003. Le **BESTMOD** fait partie d'un ensemble de Laboratoires qui ont été officiellement validés et financés par le ministère de l'enseignement supérieur de la recherche scientifique et de l'environnement.

L'objectif général de **BESTMOD** est de jouer un rôle actif dans le développement national et international de la recherche dans le domaine de la modélisation, prévision et simulation des phénomènes économiques, financiers et sociaux. **BESTMOD** est une équipe de recherche composée (en **2003**) de **67** membres (enseignants chercheurs et étudiants chercheurs) dont **9** appartiennent au corps **A**, **25** au corps **B**, **16** assistants contractuels, **1** professeur de l'enseignement secondaire et **8** **étudiants** chercheurs. Au terme de la préparation de ce rapport, **3** enseignants du corps **B** préparent l'**habilitation universitaire**, **1** enseignant prépare sa maîtrise de conférence, **4** préparent leurs maîtrises d'assistantat, **35** membres préparent un **diplôme de doctorat** et **8** préparent un **diplôme de DEA**. De nouveaux membres se sont joints à l'équipe (voir liste des nouveaux membres). L'équipe de **BESTMOD** tire sa force de sa masse critique, de la diversité et de la complémentarité de ses chercheurs. La diversité provient des profils de ses membres qui appartiennent à des écoles différentes (américaines tunisiennes et françaises) et de la dimension internationale avec la participation de professeurs Tunisiens exerçant dans des universités françaises et américaines. Ces derniers ont contribué de manière effective à l'encadrement des chercheurs et à la production scientifique de haut niveau de l'équipe **BESTMOD**. La complémentarité réside dans la diversité des spécialités des membres (Economistes, Economètres, Statisticiens, Informaticiens, Mathématiciens, Financiers, spécialistes des ressources humaines). A l'occasion de la nouvelle restructuration de la recherche et dans une initiative de fédération des potentialités scientifiques et d'ouverture vers d'autres disciplines l'équipe **BESTMOD** a voulu initier la création d'un pôle de compétence en renforçant ses rangs par des chercheurs appartenant à institutions universitaires nationales et internationales telles que les facultés des sciences économiques de Tunis et de Sousse, à l'IHEC, l'ISG de Sousse, l'ISCAE, L'ESSEC, Columbia University, l'Université de Montpellier, l'Université Paris I, l'université de

Strasbourg, l'université de Montréal, l'université d'Aix-Marseille (Laboratoire **GREQAM**), l'université de Cergy Pontoise, etc. La thématique générale abordée par **BESTMOD** est **d'actualité** et s'insère de manière parfaite dans le cadre des orientations nationales de prospective stratégique dans un contexte international de globalisation caractérisé par des mutations perpétuelles. Le pilotage, de cette dynamique nouvelle et du nouveau paysage géopolitique nécessite des capacités importantes de mise en place et de construction de modèles de prévision et de systèmes de veille, de surveillance et de prospective stratégique.

Les objectifs spécifiques du programme de recherches au BESTMOD sont :

1. La production et la diffusion des recherches
2. La création des relations avec d'autres centres de recherches
3. Le développement et la mise en place, en collaboration avec les institutions publiques et/ou privés, des modèles de prévision et de systèmes de veille, de surveillance et de prospective adaptée à la nouvelle dynamique dans une perspective, nationale, régionale et internationale, et de regrouper des potentialités scientifiques complémentaires capables de résoudre des problèmes réels parfois difficiles à résoudre individuellement. L'association dans la production scientifique, envisagée, sur les plans national et international, est devenue une nécessité vue la rapidité des mutations technologiques.
4. La mise en place d'un Master de Prévision et de Prospective des Phénomènes Financiers Economiques et Sociaux.
5. L'organisation de colloques et de rencontres scientifiques portant sur les sujets liés à la thématique générale.
6. L'encadrement de la recherche

Depuis sa création, **BESTMOD** a misé sur l'excellence dans l'encadrement de la recherche et la formation diplômante tout en s'inspirant des orientations de la politique nationale en matière de développement technologique et scientifique. Par ailleurs, les membres de **BESTMOD** maintiennent un rythme de production continu et soutenu et les résultats de leurs travaux sont publiés dans des revues scientifiques respectées.

7. Réalisation de projets de recherches et de développement économique et technologique et ouverture sur l'environnement de l'entreprise pour la réalisation de projets de recherches et de développement en étroite collaboration.

Dans tous les domaines cités le présent rapport devrait permettre au lecteur de mieux connaître les activités qui furent celles du laboratoire **BESTMOD**.

2. Vocation du BESTMOD

Le **BESTMOD** est d'abord un laboratoire se consacrant à la recherche. Son propos est de développer des recherches avancées dans les domaines d'étude et formations de 3ème cycle qui lui sont liées et de les faire reconnaître par des publications. L'encadrement renforcé des chercheurs, la multiplicité des contacts de ses membres avec des institutions de recherche, des revues, etc... constituent à présent un cadre d'autant plus favorable. L'ambition de ce laboratoire est aussi de favoriser l'insertion de ses chercheurs dans la communauté scientifique internationale. Par ses dimensions et son projet fédérateur, il sera à même de contribuer à la cohérence des actions et recherches engagées en matière d'économie. Il entend encore faciliter l'insertion professionnelle des étudiants de DEA, des doctorants et des docteurs qui lui sont rattachés; le suivi de leur parcours professionnel est l'un de ses soucis.

3. Retombées socio-économiques

Le **BESTMOD** noue des relations étroites avec d'autres centres universitaires de recherche tunisiens ou étrangers, mais aussi avec des institutions non strictement universitaires, en considération de l'expertise qu'ils auraient su acquérir dans les domaines d'étude correspondant à ses propres programmes de recherche - en particulier les organismes de modélisation macroéconomique, de prévision conjoncturelle et de l'environnement. Développer des réseaux très larges - une condition indispensable à la recherche - constitue l'un des soucis majeurs de notre

laboratoire. Il collabore déjà avec: l'ITES (Institut Tunisien des Etudes Stratégiques), l'IEQ (Institut d'Etude Quantitative), l'AIMAREX, l'ANPE (Agence Nationale de Protection de l'Environnement), l'ANER (Agence Nationale des Energies Renouvelables), l'OTED (Observateur Tunisien de l'Environnement et du Développement Durable) et divers laboratoires appartenant à d'autres universités étrangères.

En effet, l'équipe du **BESTMOD** s'est donnée comme objectifs de participer activement à la réalisation des projets de recherche qui ont des retombées socio-économiques et qui s'inscrivent dans le cadre des priorités nationales. Dans le cadre de l'étude stratégique ENERGIE 21 et suite à la demande de l'Institut Tunisien des Etudes Stratégiques (ITES), le **BESTMOD** a pu développer un modèle d'évaluation et de simulation des Politiques Energétiques à long terme, horizon 2030 (Secteur Industriel et de Transport) pour la Tunisie. Dans ce même cadre de coopération **BESTMOD-ITES**, et en collaboration avec l'Institut Nationale des Statistiques (INS), l'équipe **BESTMOD** a participé à la conduite de l'enquête " **La Tunisie à l'écoute de sa jeunesse** ", la conception du questionnaire jusqu'à traitement informatique des données et leur interprétation. Les travaux étaient très satisfaisants. **BESTMOD** a réalisé aussi pour le compte de l'ITES des travaux dans le domaine de la démographie économique. D'autres travaux ont été réalisés pour le compte de l'Institut d'Economie Quantitative (IEQ) qui consistent en la modélisation du taux de change: Comparaison Internationale.

Actuellement, les principaux axes de recherche de l'équipe sont définis à partir des orientations nationales, on peut citer à titre d'illustration, le thème de désagrégation temporelle des données économiques. Ce thème est l'objet d'une thèse de doctorat en cours intitulée: Une méthode d'étalonnage de données pour la désagrégation temporelle des données économiques: Théorie et Application (Exemples traités: Trimestrialisation des compte nationaux et détermination du PIB trimestriel ou mensuel à partir du PIB annuel). Les autres activités de recherches a retombées socio-économiques et continuent de faire l'objet de thème assignés aux membres **BESTMOD** sont :

- ? Prévision de la conjoncture économique et financière
- ? Système de surveillance et prévision du cycle économique (prévision des récessions et expansions).
- ? Gestion financière et gestion des risques.
- ? Modélisation, prévision et simulations de phénomènes environnementaux.

4. L'assistance à la recherche

Le **BESTMOD** sert de laboratoire d'encadrement pour les mémoires et les thèses élaborés par les étudiants affiliés (voir tableaux 5.2.1 et 5.2.2), pour un très grand nombre de thèses (plus de trente actuellement) et de travaux sur contrat.

Par ailleurs, il a pu organiser divers séminaires ou ateliers : Un séminaire général où interviennent ses membres et des conférenciers appartenant à d'autres universités étrangères (projet CMCU avec l'université d'Aix Marseille, Ecole doctorale avec les universités: Lyon, Saint-Etienne, Strasbourg, Marseille, Montpellier) et des séminaires spécifiques propres à chaque groupe de chercheurs travaillant sur un même thème (notamment, en finance et en économétrie).

Une collection de "**Working Papers**" est destinée à faire connaître les travaux et recherches menés dans ce laboratoire ; pour les études réalisées, ces documents constitueront un banc d'essai avant leur proposition à des revues ou leur présentation sous forme de communications dans des colloques.

Dans un soucis continu de s'ouvrir à son environnement économique et industriel et dans le cadre de la coopération franco-Tunisienne (**CMCU 02F1501**) le Laboratoire **BESTMOD** a pu organiser au cours de l'an 2002 en collaboration avec le Laboratoire **GREQAM** de l'Université d'Aix-Marseille et le Secrétariat d'Etat à l'Environnement et aux Ressources Hydrauliques le **premier** colloque international sur l'environnement intitulé « **Modélisation Statistique pour l'Environnement : Gestion de la Qualité de l'air en milieu Urbain** ». La participation des Agences Nationales de Protection de l'Environnement (**ANPE**), des Energies Renouvelables (**ANER**), et de l'Observatoire Tunisien de l'Environnement et de Développement

durable (**OTED**) a été importante. **BESTMOD** a été aussi le principal organisateur de la Seconde Conférence Internationale de Finance qui a eu lieu à Hammamet au mois de mars 2003 et qui a pu réunir 300 participants répartis entre 33 nationalités. Notre laboratoire **BESTMOD** a contribué par onze (11) publications et huit (8) communications.

Le Laboratoire contribue à la formation des formateurs par sa participation active aux projet Européen **MEDFORIST** pour la mise en place d'une plateforme de partage des connaissances et l'enseignement à distance en partenariat avec l'**Ecole Supérieure de Commerce de Grenoble** et le projet **SUNNY** en partenariat avec l'**Université SUNNY de NEW YORK**.

5. Organisation générale du BESTMOD

Thématique générale des activités de recherche :

Modélisation, Prévision, Prospective stratégique et simulation des phénomènes financiers, économiques et sociaux.

Dénomination de l'unité de recherche :

BESTMOD (**B**usiness and **E**conomic Statistics **MOD**eling
Code : LAB - SEG – 01 .

5.1 Directeur du Laboratoire

Nom : **TRABELSI**
Prénom : **Abdelwahed**

Spécialité :
*Modélisation Statistique et Econométrie,
Prévision et Prospective*

Fonction : Directeur de l'Institut
Supérieur de Gestion de Tunis

Etablissement : Institut Supérieur de Gestion,
Université de Tunis

Grade : Professeur

Adresse professionnelle:
41, Rue de la liberté Cité Bouchoucha,
2000, Le Bardo, Tunis

Tél: (216) 71 56 03 78
Fax: (216) 71 56 87 67
e-mail: Abdel.trabelsi@isg.rnu.tn

5.2 Personnel Scientifique

5.2.1 Composition du L.R de l'année 2002-2003

Nom & Prénom	C.I.N	Grade	Fonction ou Qualité	Etablis	Objectifs des activités de recherche			Sujet de recherche
					Encadrement	Act.Dipl:DEA, NT,TE	HbUniv Agrég.HU	
TRABELSI Abdelwahed	00894150	Pr	Enseig	ISGT	✗			Modélisation et prévision des phénomènes économiques et sociaux
GANNOUN Ali	04057101	Pr	Enseig	Université de Montpellier	✗			Prévisions non paramétriques des séries temporelles
JDIDI Kamel		Pr	Enseig	Colombia University	✗			Modélisation et recherches en marketing
BELKACEM Lotfi	4146109	MC	Enseig	IHECSo	✗			Evaluation et couverture des risques extrêmes en finance
HALLARA Slaheddine		MC	Enseig	ISGT	✗			Finance des marchés
KHEDHIRI Sami	02247849	MC	Enseig	FSEG T	✗			Tests récurrents de stabilité des paramètres
MAMOGHLI Chokri	01679418	MC	Enseig	ESSEC	✗			Marchés financiers, marchés des capitaux : Efficience et modèle d'évaluation d'actifs
TRABELSI Jamel	1603865	MC	Enseig	FSEGS	✗			Tests de racines unitaires et les modèles ARCH
TRIKI Abdelfattah		MC	Enseig	ISGT	✗			Marketing
BEN SEDRINE Nadia		MA	Enseig	ISGT	✗		Hb	Théorie d'agences

BOUGHRARA Adel		MA	Enseig	FSJEPS	✍		Hb	Modélisation macro-économique et politique monétaire
FARHAT Abdeljalil	3831645	MA	Enseig	ISCAE	✍		MC	Tests basés sur la simulation Monte Carlo
ROMDHANE Mohamed	0002189	MA	Enseig	ISGT			Hb	Théorie bancaire
BELKHAOUI Samir	6759785	Ass	Enseig			NT		Application de la théorie des options à l'explication de la structure du capital et la prime de risque de faillite
BEN MAATOUG Abderrazek	0262996	Ass	Enseig	ISGT	✍		MA	Cointégration dans les Modèles VAR (Séries temporelles)
BOUGHANMI Akri	4600921	Ass	Enseig	ISCAE		NT		Commerce international et croissance
EL -HABIL Abdalla	AP990001	Ass	Enseig	Palestine		NT		Modélisation des observations aberrantes dans les séries temporelles
GATTI Dorra	4772710	Ass	Enseig	HECT		NT		Intégration et mécanisme de transmission des mouvements des marchés financiers : Théorie et évidence empirique
GHARBI Sami	2300801	Ass	Enseig	FSJEG J		NT		Causes et mécanismes de régulation de la volatilité des marchés boursiers,
GHNIMA Zahra	04768698	Ass	Enseig	ISCAE		NT		Combinaisons des prévisions : une approche unifiée
HEDHILI Leila	05182154	Ass	Enseig	FSEGN		NT		Méthode d'étalonnage et désagrégation temporelle des données économiques : Théorie et application
JLASSI Rabeh	00743072	Ass	Enseig	ISGSo		NT		Séries temporelles multiples : Théorie et application à la prévision de la conjoncture économique en Tunisie
KAMMOUN Aida	0528167	Ass	Enseig	ESC S		NT		Modélisation, prévision et évaluation de l'impact de la libéralisation sur les activités réelles et financières
KHEMIR Ines	06292691	Ass	Enseig	FSJEG J		NT		Economie de la saisonnalité : modélisation statistique et prévision
KSONTINI Hager	4771947	Ass	Enseig	ISGSo		NT		Modélisation non linéaire multivariée : prévision et arbitrage sur les marchés des changes

LACHAAB Mohamed	02562770	Ass	Enseig	ISGT		NT (Soutenue)	MA	Analyse Bayésienne d'un modèle Probit
MANAI Salha	04778585	Ass	Enseig	ESCAE		NT		Time series model selection : A Bayesian approach
MEHRI Siwar	04634880	Ass	Enseig	ESSEC		NT		Prédictibilité et impact des crises de change sur les activités économiques réelles
METHLOUTHI AMIRA/ Monia	5102815	Ass	Enseig	ISGSo		NT		Le Modèle à volatilité stochastique à mémoire longue : Estimation et Prévision
MEZNI Ridha	00466508	Ass	Enseig	SGT		TE		Statistique Spatiale
OUEDERNI Hayet		Ass	Enseig	FSEGN		NT (Soutenue)	MA	Structures financières et performances : application aux entreprises tunisiennes
SAIDANE Mohamed	07270384	Ass	Enseig	ISGG		NT		Inférence Bayésienne et Sélection de Portefeuilles basées sur les Structures Latentes des Modèles à Facteurs Dynamiques
SLIM Chokri	00898398	Ass	Enseig	ISCAE		NT (Soutenue)	MA	Réseaux de neurones dynamiques et modélisation des phénomènes chaotiques
YOUSSEF Fatma	4466349	Ass	Enseig	ISGSo		NT		Modélisation non linéaire des cycles économiques
BERGAOUI Nejla	05823906	AssC	Enseig	ISGT		NT	Ass	Anomalies dans les rentabilités anticipées des actions
DERBEL Walid	05270649	AssC	Enseig	ISGT		NT	Ass	Le soutien organisationnel aux relations de confiance et de coopération,
EL MONTASSAR Ghassen	04866415	AssC		FSEGT		DEA (Soutenue)		Modèles d'ajustement saisonnier
HAJJEJI Lamia	5548520	AssC	Enseig	ISGT		NT	Ass	Conditionnal multi-asset intertemporel capital asset pricing model,
JELASSI Selma		AssC	Enseig	FSEGT		NT		Econométries spatiales : Approche classique et Bayésienne, Application au processus spatial de non-emploi.

KAMARGI Sameh	0613216	AssC	Enseig	ISGT		NT		L'hypothèse de non biais à terme réexaminé
OCHI Wejda	07284215	AssC	Enseig	ESC		NT		La couverture à terme du risque de portefeuille.
OUEDERNI Karima	00379585		Enseig			NT		Impact de la structure de la propriété sur la volatilité des rendements des entreprises opérant sur les marchés émergents
RAGGAD Bechir	05729917	AssC	Enseig	ESSEC		NT	Ass	Théories des valeurs extrêmes pour la gestion des risques : application en finance et en environnement,
ZARROUK Wided		AssC	Enseig	ISGT		NT	Ass	Stabilisation des recettes commerciales
CHOUIKH Aziz	04610707			ISGT		NT		Financial and statistical modeling of risk premia and prediction : theory and applications
OUESLATI Amor	04644327			ISGT		NT	Ass	Analyse a haute fréquence des données financières irrégulièrement espacées : une approche hiérarchique bayésienne,
ZRIBA Adel	3155891			ISGT		NT		Prévision de la conjoncture économique par les modèles de Markov cachés

5.2.2 Les nouveaux membres du L.R de l'année 2003

Nom & Prénom	C.I.N	Grade	Fonction ou Qualité	Etablis	Objectifs des activités de recherche			Sujet de recherche
					Encadre-ment	Act.Dipl:DEA, NT,TE	HbUniv Agrég.HU	
GRGOURI Chanaz		0 \$	(OHL	6DQV 3HNLis &RQIH 86\$				Harmonized Organizational Culture
AJMI Ahdi Noomen	04657600	AssC	Enseig	ISGT		NT		Estimation et inférence des modèles de régression à mémoire longue
%(/ / \$ -0 R]		\$ V&	(OHL	(6& 6IQ				Valeur de la Marque : antécédents et impacts sur la décision d'achat
BEN ISHAK Anis	04656793	AssC	Enseig	ISGT		NT		Agrégation de Méthodes d'Apprentissage Statistique pour la Gestion et la Prévion de la Qualité d' Air en Tunisie.
Ben Naoui Leila			Et	ISGT		DEA		Prévion du comportement futur des firmes de nouvelles technologies
BEN ROMDHANE Ons		AssC	Enseig	ISGT		DEA (Soutenue)		Conception et réalisation d'un algorithme d'apprentissage des perceptrons multicouches pour la prévion des séries temporelles.
Bou Allagui Imen			Et	ISGT		DEA		Modèle d'ajustement – Structure de capital
CHERIF Selima		AssC	Enseig	ESC		NT	Ass	Evaluation des projets d'investissement par les options réelles en présence des coûts d'information : le cas d'une société pharmaceutique

CHERNI Imen				ISG		DEA (Soutenue)		Efficiencce des marchés financiers ; Cas de la BVMT.
CHTIOUI Halima		AssC	Enseig	FSEG Mehdia		DEA (Soutenue)		Impact de la structure d'âge sur le taux de change réel
EL ARBI Hassine			Et	ISGT		DEA		Evaluation des crédits bancaires avec les réseaux de neurones
EL AYECH Hafedh	04661125	PES	Enseig	ISGT		DEA (Soutenue)		Les modèles Airline : Approche Classique et Approche Connexionniste
FERCHICHI Kaouther	05222710	AssC	Enseig	ISGT		NT		Conception d'un Système d'Alarme Médical Temporel Multi-Agents
GETFAOUI Jamel	08201037		Et	ISGT		DEA		Book-to-market, taille, risque et prévision des rendements des portefeuilles
GORBEL Ahmed		AssC	(QHI	,6* 7		DEA (Soutenue)		Mécanisme de transmission de la volatilité des indices boursiers
HADFI Souhir				ISGT		DEA (Soutenue)		Commerce électronique
HANAFI Walid			Et	ISGT		DEA		Evaluation des prix des actifs financiers avec les réseaux de neurones
HAZEM Mohamed			Et	ISGT		DEA		Prévision des prix de logement : une approche spatiotemporelle
KAMMOUN Istabrak		AssC	(QHI	ISGT				La fidélité à la marque : une approche relationnelle
SIFFI Sami			Et	ISGT		DEA		Introduction des techniques non paramétriques dans la modélisation GARCH du premier ordre : application et interprétation
TNANI Dorra Kaouther			Et	ISGT		DEA		Modèle de changement de régime

5.3 Visiteurs et séminaires avec les partenaires du BESTMOD (2000- 2003)

Fidèle à sa politique d'ouverture à la coopération internationale et à la recherche de partenariat et afin consolider ses acquis en matière d'encadrement de la recherche **BESTMOD** a fait appel à un certain nombre de professeurs, qui sont des autorités dans leurs domaines respectifs d'expertise, pour participer à ses activités de formation par la recherche. Les professeurs visiteurs pour l'année 2000-2003 sont listés dans le tableau suivant :

Nom Prénom	Université	Thèmes	Activités	Année
Andrew Harvey	Cambridge, GB	Modèles Espace d'état : théorie et application à la prévision des mouvements des marchés financiers	Séminaires & Encadrement de thèses	2000
Jean Marie DUFFOUR	Montréal, Canada	Méthodes de simulations exactes en échantillons finis	Séminaires & Encadrement de thèses	2000
Jian-Feng. Yao	Paris I, France	Les modèles autorégressifs à changements markovien	Séminaires & Encadrement de thèses	2000
Ali Gannoun	Montpellier, France	Prévision non paramétrique des séries temporelles	Séminaires & Encadrement de thèses	2000
Claude Deniau	Marseille France	Régression non paramétrique : Application à la prévision de la pollution atmosphérique	Séminaires & Encadrement de thèses	2001
Jamel Trabelsi	Strasbourg, France	Impact des Chocs monétaires sur les activités réelles et financières	Séminaires & Encadrement de thèses	2001
Olivier Channel	Aix-Marseille II	Difficultés liées à l'évaluation économique des effets de la pollution atmosphérique.	Séminaires & Encadrement de thèses	2002
Claude Deniau	Aix-Marseille II	La prévision d'épisodes de pollution atmosphérique : où sont les difficultés, quelles sont les méthodes statistiques ?	Séminaires & Encadrement de thèses	2002
Badih Ghattas	Aix-Marseille II	Prévision de la pollution atmosphérique par arbres de décision simples et agrégés par bootstrap	Séminaires & Encadrement de thèses	2002
Laetitia Mary	Aix-Marseille II	Le rôle des associations de surveillance de la qualité de l'air en France : exemple d'Airmariaix (surveillance des bouches-du-Rhône, du Var et du Vaucluse)	Séminaires & Encadrement de thèses	2002
Fethi Hanchi	Ingénieur à l'Agence Nationale de Protection de l'environnement	Mesures d'atténuation de la pollution atmosphérique et programme futur d'amélioration de la qualité de l'air	Séminaires	2002

Houda BelHadj Kacem	Ingénieur à l'Agence Nationale de Protection de l'environnement	Gestion de la Qualité de l'air en Milieu Urbain cas de la Tunisie	Séminaires	2002
Walid Rekik	Observatoire Tunisien de l'Environnement et du Développement Durable	Les indicateurs du développement durable en Tunisie	Séminaires	2002
Jean Paul Pollin	Université d'Orléan	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Jean Pierre Faugere	Université de Paris Sud	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Catherine Loboehinsky	Paris II ASSAS	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Bertrand Bellm	Université de Paris Sud	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Isabelle Manreguart	Université de Tours	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Abdelhaq berramdane	Université de Tours	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Adel ben Youssef	Université de Paris Sud	Intervention dans le cadre du master entreprise et marchés européens	Séminaires	2002
Mondher Cherif	Université Paris XII	Investissement et capital risque	Séminaires & Encadrement de thèse	2002
Mondher Blallah	Université de Cergy Pontoise	Marché des produits dérivés	Séminaires & Encadrement de thèses	2003
Gordan Alexander	UCLA and University of Minnesota, USA	Conditional Value at Risk as a measure of Risk	Conférence Internationale de Finance	2003
Gordan Scik	University of Calgary, CANADA	Pricing Electricity Calls	Conférence Internationale de Finance	2003
Aman Agrawal	Associate Editor Finance India	Options Futures and Other Derivatives	Conférence Internationale de Finance	2003
Jean François Boulter	Synopia Asset Management	Gestion des Risques Financiers	Conférence Internationale de Finance	2003
François Quittard - Pinon	Université de Lyon	Change of Probability Measures in Finance and Insurance	Conférence Internationale de Finance	2003
Patrice Fontaine (Directeur du Laboratoire CERAG)	Président de l'Association Française de Finance (AFFI).	Evolution des Marchés financiers	Conférence Internationale de Finance	2003

6. sujets de recherches du BESTMOD

1. Modélisation, Prévision et Simulation des Phénomènes Economiques et Sociaux

Mots clefs: Séries Temporelles univariées et multivariées, Simulation Monte-Carlo, Prévision

2. Prévision et Prospective Stratégique

Mots clefs: Modèles de Prévision à long terme, Prospective stratégique.

3. Modélisation Econométrique des Politiques de l'Emploi et du Comportement du Marché du Travail

Mots clefs: Politiques Actives de l'Emploi, Dualisme Salarial, Insertion Professionnelle et Ancienneté de chômage, Disparités spatiales et Sectorielles des Ancienneté de chômage en **Tunisie**.

4. Prévision de la conjoncture économique et financière

Mots clefs: Séries temporelles, prévision, Indicateurs précurseurs de conjoncture

5. Système de surveillance et prévision du cycle économique (prévision des récessions et expansions)

Mots clefs: Séries temporelles, Prévision, Cycles économiques, Points de retournement, Système de pilotage et d'alarme.

6. Modélisation et prévision de la Dynamique des Marchés Financiers et des marchés de change

Mots clefs: Modèles à variance conditionnelle, Persistance de la volatilité sur les marchés financiers, Transmission des mécanismes et Intégration des marchés Financiers., Prédictibilité et volatilité dans les marchés émergents, Réaction des marchés boursiers aux annonces macro-économiques, Intégration et transmission des mécanismes de prix sur les marchés internationaux. Modélisation de la prime de risque sur les marchés financiers

7. Développement d'un Système de Prévision et d'alarme pour les crises de change

Mots clefs: Crises Financières, Modèles à Plusieurs Régimes, Système de Pilotage

8. Modélisation, Prévision et Simulation des Politiques Energétiques

Mots clefs: Modèle Technico-économique, Intensité énergétique, Simulation.

9. Démographie Economique

Mots clefs: Dynamique de la pyramide des âges, Vieillesse démographique, Gestion de la pyramide des âges

10. Enquête et Sondage

Mots clefs: Ajustement des données, Enquêtes répétées, Sondage.

11. Réseaux de Neurones et Prévisions des Séries Temporelles

Mots clefs: Réseaux de Neurones artificiels, Simulation, Phénomène chaotique.

12. Modélisation et Prévision des Phénomènes Macro-économiques et Monétaires

Mots clefs: Effet des fluctuations du taux de change sur la balance commerciale en Tunisie, Modèle à mémoire longue pour le taux d'inflation, Transmission des mécanismes monétaires en Tunisie une approche VAR, Politique monétaire et structure par terme des taux d'intérêt

13. Modèles d'Economie Politique

Mots clefs: Economie politique des institutions financières des pays en voie de développement, compétitivité.

7. Réalisations (2000-2003)

7.1 Séminaire de recherche hebdomadaire

Fidèle à sa vocation d'adhésion pour l'excellence en matières de recherche et afin de maximiser les chances de réaliser les objectifs spécifiques qu'elle s'est fixés, l'équipe **BESTMOD** s'est engagée à maintenir un rythme soutenu de travail qu'elle a concrétisé par l'organisation d'un séminaire de recherche hebdomadaire permanent avec une participation massive. Ce séminaire constitue pour les encadreurs de **BESTMOD** un système de pilotage des recherches et d'évaluation des résultats des jeunes chercheurs.

Cette activité s'est soldé par :

- ✍ l'obtention de diplômes (thèses, DEA)
- ✍ L'obtention d'habilitation universitaire
- ✍ Passage de grades
- ✍ la réalisation d'une série de documents de travail
- ✍ La publication d'un certain nombre d'articles
- ✍ La participation effective par des communications dans des colloques

7.2 Diplômes obtenus et passages de grades (2000-2003)

7.2.1 Maîtrise de conférence

Nom(s) & Prénom (s)	Poste	Date	Lieu
Belkacem Lotfi (Directeur IHEC Sousse)	Maîtrise de conférence	Juin 2000	IHECSO
Hallara Sleheddine (Directeur IHET)	Maîtrise de conférence	2001	ISG
Khdhiri Sami	Maîtrise de conférence	Décembre 2000	FSEGT
Mamoghli Chokri (Directeur ESSEC Tunis)	Maîtrise de conférence	Septembre 2001	IHEC
Trabelsi Jamel	Maîtrise de conférence	2002	FSEGS

7.2.2 Habilitation

Nom(s) & Prénom (s)	Diplôme	Date	Lieu
Belkacem Lotfi	Habilitation	Juin 2000	ISGT
Hallara Sleheddine	Habilitation	2000	ISGT
Khdhiri Sami	Habilitation	Décembre 1999	FSEGT
Mamoghli Chokri	Habilitation	Septembre 2000	ISGT
Trabelsi Jamel	Habilitation	2002	FSEGS
Abdeljilil Farhat	Habilitation	2002	ISGT

7.2.3 Thèse

Nom(s) & Prénom (s)	Diplôme	Date	Lieu
Abdeljilil Farhat	Nouvelle Thèse	Octobre 1999	ISGT
Chokri Slim	Nouvelle Thèse	Juillet 2000	ISGT
Lachaab Mohamed	Nouvelle Thèse	Mars 2003	FSEGT
Ouedrni Hayet	Nouvelle Thèse	Avril 2003	ISGT

7.2.4 Assistanat

Nom(s) & Prénom (s)	Poste	Date	Lieu
Belkhaouia Samir	Assistanat	Août 2002	FSEGSO
Gatti Dorra	Assistanat	Août 2000	IHECT
Gharbi Sami	Assistanat	Août 2001	FSEGT
Ghnima Zahra	Assistanat	Août 2001	FSEGT
Hedhili Leila	Assistanat	Août 2001	FSEGN
Jlassi Rabeh	Assistanat	Août 2001	ISGS
Kammoun Aida	Assistanat	Août 2001	FSEGS
Khemir Ines	Assistanat	Août 2000	FSEGT
Ksontini Heger	Assistanat	Août 2002	ISGS
Manai Salha	Assistanat	Août 2001	ISCAE
Mehri Siwar	Assistanat	Août 2001	ESSEC
Ouedrni Hayet	Assistanat	Août 2002	FSEGN
Saidane Mohamed	Assistanat	Août 2002	ISGG

7.2.5 Contrats Assistants

Nom(s) & Prénom (s)	Poste	Date	Lieu
BERGAOUI Nejla	Contrat Assistant	Septembre 2001	ISGT
DERBEL Walid	Contrat Assistant	Septembre 2000	ISGT
EL MONTASSAR Ghassen	Contrat Assistant	Septembre 2001	FSEGT
HAJJEJI Lamia	Contrat Assistant	Septembre 2001	ISGT
JELASSI Selma	Contrat Assistant	Septembre 2000	FSEGT
KAMARGI Sameh	Contrat Assistant	Septembre 2001	ISGT
OCHI Wejda	Contrat Assistant	Septembre 2001	ESC
RAGGAD Bechir	Contrat Assistant	Septembre 2001	ESSEC
ZARROUK Wided	Contrat Assistant	Septembre 2002	ISGT
AJMI Ahdi Noomen	Contrat Assistant	Septembre 2002	ISGT
BEN ISHAK Anis	Contrat Assistant	Septembre 2002	ISGT
BEN ROMDHANE Ons	Contrat Assistant	Septembre 2002	ISGT
CHERIF Selima	Contrat Assistant	Septembre 2002	ESC
CHTIOUI Halima	Contrat Assistant	Septembre 2002	FSEG Mehdia
FERCHICHI Kaouther	Contrat Assistant	Septembre 2001	ISGT
GORBEL Ahmed	Contrat Assistant	Septembre 2002	ISGT

7.2.6 Diplôme des Etudes Approfondies

Nom(s) & Prénom (s)	Diplôme	Date	Lieu
Ajmi Ahdi Noomen	DEA	Juin 2002	ISGT
Ben Ishak Anis	DEA	Juin 2002	ISGT
Ben Romdhane Ons	DEA	Décembre 2002	ISGT
Ben Salem Sondes	DEA	Septembre 1999	ISGT
Bergaoui Nejla	DEA	Juin 1999	ISGT
Charfi Aida	DEA	Septembre 1999	ISGT
Cherni Imène	DEA	Décembre 2002	ISGT
Chouari Elyes	DEA	Juin 1999	ISGT
Chouikh Aziz	DEA	Juin 1999	ISGT
Chtioui Hlima	DEA	Juin 2002	ISGT
Derbel Walid	DEA	Septembre 1999	ISGT
El Aych Hafedh	DEA	Décembre 2002	ISGT
El Montassar Ghassen	DEA	Juin 2001	ISGT
Gharbi Sami	DEA	Août 2001	ISGT
Ghnima Zahra	DEA	Août 2001	ISGT
Ghordel Ahmed	DEA	Juin 2002	ISGT
Hajjeji Lamia	DEA	Septembre 1999	ISGT
Hedfi Souhir	DEA	Décembre 2002	ISGT
Hedhili Leila	DEA	Juin 1999	ISGT
Khemir Ines	DEA	Août 2000	ISGT
Kouki Imen	DEA	Juin 1999	ISGT
Manai Salha	DEA	Août 2001	ISGT
Ouederni Karima	DEA	Juin 1999	ISGT
Oueslati Amor	DEA	Septembre 2000	ISGT
Raggad Béchir	DEA	Septembre 2001	ISGT
Saidane Mohamed	DEA	Août 2000	ISGT
Zoghلامي Faten	DEA	Juin 1999	ISGT
Zriba Adel	DEA	Juin 1998	ISGT

7.3 Production scientifique

7.3.1 Publications

Année 2003

1. Kamel Jedidi (2003) « Measuring heterogeneous reservation prices from product bundles» Marketing Science Vol22, N°1 p 107-131
2. Nejla Bergaoui, Abdelwahed Trabelsi (2003) « The Tunisian Stock Market Responses To Macroeconomic Announcements » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 211-234, Tome 2
3. Slaheddine Hellara, Imen Snoussi (2003) « Performance Evaluation of Hedge Funds : a literature review of theoretical and empirical issues and contributions » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 512-539, Tome1
4. Slaheddine Hellara, Lahmar Samah (2003) « Extraction de l'information à partir des prix des options de change » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 168-188, Tome 2
5. Slaheddine Hellara, Sana Othman (2003) « Les mesures de performance des SICAV et la psychologie de l'investisseur dans leur gestion de pondération » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 346-403, Tome2
6. Slaheddine Hellara, Imene Safer (2003) « marché émergent et mimétisme» Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 429-450, Tome2
7. Slaheddine Hellara, Imen Bedoui (2003) « Relation de change d'équilibre: test de cointégration dans le cas de la Tunisie » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 43-59, Tome3
8. Chokri Mamoghli, Wejda Ochi (2003) « L'Emergence Des Marchés Dérivés a-t-elle Un Effet Sur La Volatilité Des Rendements Des Actifs Sous-jacents?» Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 472-486, Tome5
9. Chokri Slim, Abdelwahed Trabelsi (2003) « Modeling Financial Time Series With Artificial Neural Network » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 543-559, Tome1

10. Chokri Slim, Abdelwahed Trabelsi (2003) « Neural Network For Modeling Non Linear Time Series : A New Approach » Special Issue in Computing Science, Spring Veralag 2003
11. Chokri Slim, Abdelwahed Trabelsi (2003) « Neural Network For Modeling Financial Time Series : A New Approach » Special Issue in Computing Science, Spring Veralag 2003
12. Abdelwahed Trabelsi, Wided Zarrouk, Abderrazzak Ben Maatoug (2003) «Analysis Of The Dynamics Of Various Coffee Types Prices » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 189-210, Tome 2
13. Abdelwahed Trabelsi, Ahdi Noomen Ajmi , Ahmed Ghorbel (2003) « The Reserve Bank of Australia Intervention : Exchange Rate Volatility From a FIGARCH Modeling » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 130-139, Tome4
14. Abdelwahed Trabelsi, Amor Oueslati (2003) « The Dynamics Of Stock Price Adjustments To New Information : Empirical Evidence From The Tunisian Stock Exchange Market » Proceedings of International Finance Conference 2, Tunisia 2003, p 288-312, Tome5
15. Lotfi Belkacem, O. Zaghdoud (2003) «Politique Environnementale, Taxes discordantes sur le travail, gains de bien être et double dividendes » Colloque de la 4^{ème} université du GRECOS à Perpignan, France 2003

Année 2002

16. Ali Gannoun et Jérôme Sarcco (2002) « A new proof of strong consistency of kernel estimation of density function and mode under random censorship » Statistics and Probability letters Vol 59 n°1 p 61-66
17. Jan G De Gooijer, Ali Gannoun , Dawit Zerom (2002) « Mean Squared error properties of kernel based multi-stage median predictor for time series » Statistics and Probability letters Vol 56 n°1 p 51-56
18. Alain Berlinet, Benoît Cadre et Ali Gannoun (2002) « Estimation of conditional L1 – median from dependent observations » Statistics and Probability letters Vol 55 n°4 p 353-358

19. Kamel Jedidi (2002) «Augmenting conjoint analysis to estimate consumer reservation prices» *Management Science* Vol 48 n°10 p 1350-1398
20. Abdelfattah Triki (2002) «Perceived Product Instrumentality : The Process of Scale Purification and Validation », *Journal of Consumer Behaviour*, Vol 4, N°1.
21. Abdelfattah Triki (2002) « Market economy and marketing : dimensions and implications for Arab companies », Baghdad, Beitul-Hikma.
22. Adel Boughrara (2002) « Thoughts about the monetary policy: case of Tunisia » Mimeo, FIMOD, Université du centre
23. Adel Boughrara, M Smida (2002) « la politique Monétaire en Tunisie: les mots et les faits » Mimeo, FIMOD, Université du centre
24. Adel Boughrara, M Smida (2002) « Crédibilité et Politique monétaire de la BCT» Mimeo, FIMOD, Université du centre
25. Jamel Trabelsi (2002) «Approche économétrique de l'identification des sources des fluctuations dans le cadre de la théorie des cycles réelles » Colloque d'économie sociale et de développement, Istanbul (Turquie)

Année 2001

26. Lotfi Belkacem, Hugues Aubry (2001) «Modélisation fractale des rentabilités dans les marchés financiers émergents» *Techniques et Sciences Informatiques*, n°9, 2001, édition Hermès Sciences
27. Badri Djebbi, Slaheddine Hellara (2001) «Effets des transactions en blocs sur les prix des titres : analyse sur le marché tunisien » *International Finance Conference*, Tunisia 2001 p 211-238 Tome 3
28. Adel Boughrara (2001) « Money demand in Tunisia during and after the Reform period » *Saving and Development* vol XXV, p 117-137
29. Wayne S. DeSarbo, Kamel Jedidi, Indrajit Sinha (2001) « Customer Value Analysis in a Heterogeneous Market. » *Strategic Management Journal*, 22, no.9, p 845-857
30. Mohamed Bechri (2001) « Tunisia's lending program to SME Anatomy of Institutional Failure ? » *Small Business Economics* Vol 17 n°4 p 293-308

31. Aida Kammoun, Chokri Mamoghli, Abdelwahed Trabelsi (2001) « Impact des imperfections des marchés des capitaux sur le comportement d'investissement des firmes tunisiennes » International Finance Conference, Tunisia 2001 p 75-87 Tome3
32. Inès Khémir, Abdelwahed Trabelsi (2001) « Seasonal Periodic Long Memory Modeling for Inflation rates » Electronic Journal of the European Financial Management Association Journal (<http://www.odu.edu/bpa/efma/>)
33. Abdelwahed Trabelsi, Faten Zoghlami (2001) « Impact des Imperfections des Marchés des Capitaux sur le Comportement d'Investissement des Firmes Tunisiennes » International Finance Conférence, Tunisia 2001 p 88-106
34. Jamel Trabelsi (2001) « Le rôle des chocs monétaires et la persistance du taux de chômage » Economie et Prévision vol 148 n°2 p 41-48
35. Jamel Trabelsi (2001) « Volatility transmission between stock and foreign exchange market » Economia, Winter 2001 vol 5 n°2
36. Jamel Trabelsi (2001) « Francfort policy and inflationary dynamics » Séminaire de B.E.T.A. 2001
37. Abdelfattah Triki (2001) « Role Distribution among Husbands and Wives in the Process of Durable Goods Acquisition », Proceedings of the Annual Academy of Marketing Conference, Cardiff.

Année 2000

38. Abdelfattah Triki (2000) « Going Beyond Sociodemographics in Time-saving Durables Ownership Prediction », Proceedings of the Annual Academy of Marketing Conference, Derby.
39. Lotfi Belkacem, Christian Walter and Jacques Lévy-Véhel (2000) « CAPM, Risk and Portfolio Selection in Stable Markets » Fractals, vol 8, n°1, p99-115
40. Ali Gannoun , J D. De Gooijer (2000) « Nonparametric Conditional Predictive Regions for time series » Computational Statistics & Data Analysis vol 33 n°3 p 259-275.
41. Ali Gannoun, B.Cadre (2000) « An asymptotic normality of consistent estimate of the conditional L1-median » Annales de l'Institut des Statistiques Université de Paris.

42. Abdelwahed Trabelsi, Leila Hedhili (2000) « A Benchmarking Approach to temporal Credibility of Economic Time series by Related Series », 6th Great Lakes Symposium on applied Statistics.
43. Abdelwahed Trabelsi, Aida Kammoun (2000) « Modélisation des taux de change Multilatéraux » Journées Statistiques de Fes.
44. Abdelwahed Trabelsi, Elyes Chouary (2000) « Impact des politiques de libéralisation et des fluctuations du taux de change sur la balance commerciale tunisienne » Colloque ouverture économique et développement, Tunis.
45. Jamel Trabelsi , Costas Karfakis, Moïse Sidiropoulos (2000) « Testing The Credibility of stabilization Programs. Evidence from Greece », International Journal of Finance and Economics, 2000, Vol5, n°2 p165-173
46. Jamel Trabelsi (2000) « The Francfort policy and inflation dynamics » Séminaire de Statistique du Groupe de Recherché en Economie Quantitative d'Aix-Marseille (G.R.E.Q.A.M.)
47. Jamel Trabelsi (2000) « Volatility transmission between stock and foreign exchange markets» International Conference on Macroeconomic Analysis and International Finance, Crete 2000
48. Jamel Trabelsi (2000) « Vérification empirique de l'hypothèse de la crédibilité importée : le cas de la France » Séminaire de L.A.M.E.T.A., Université de Montpellier

Année 1999

49. Abdeljelil Farhat (1999), *Thèse* «Tests basés sur les simulations : théorie et applications aux modèles de régression et aux séries chronologiques » BESTMOD, ISG. Sous la direction de *Trabelsi Abdelwaherd et Jean-Marie Dufour*
50. Sami Khedhiri (1999) « Rolling Tests For Parameter Stability », Annales d'Economie de Statistique, INSEE, Paris, France
51. Sami Khedhiri (1999) «Analyse Empirique de l'Intégration des Marchés Agricoles en Tunisie », Economie Rurale, SFER , Paris, France
52. Fatin Maghrebi (1999) «On Hopfield Net Arising in Modeling and Control of over Saturated Signalized Intersection », Neural Processing Letters vol10, n°3 p 161-169

53. Mohamed Bechri (1999) « Institutional obstacles, reform uncertainty and Tunisia's integration with the European union », ERF-OECD Seminar on Euro-Med Partnership, le Caire.
54. Mohamed Bechri, B. Jeffrey, Najeh Tijani (1999) «Tunisian's lending program to SME : The case of institutional failure », World Development.
55. Mohamed Bechri (1999) « Le système financier Tunisien et l'Allocation Sectorielle du Crédit », Finance and changing trade patterns in Tunisia", IDRC-sponsored international research project, professeur responsable: Mustapha K. Nabil.
56. Abdelwahed Trabelsi, Leila Hedhili (1999) « Conception et Développement d'un modèle de Simulation et d'Analyse des Politiques Energétiques dans le Secteur Industriel Tunisien : Modèle SAPES-I". Actes du Colloque Européen sur l'énergie, p 338-357.
57. Jamel Trabelsi (1999) « Le rôle des chocs monétaires dans l'explication du taux de chômage en Allemagne » Séminaire de la Faculté des Sciences Economique de Tunis, 1999
58. Abdelfattah Triki (1999) « Developping and Validating a Model of Family Purchasing Behaviour »,Proceedings of the Annual Academy of Marketing Conference, Stirling.

Année 1998

59. Abdelfattah Triki (1998) «Testing the Theoretical Relevance For Perceived Product Instrumentality Construct of Family Purchasing Behaviour », Proceedings of the Annual Academy of Marketing Conference, Sheffield
60. Lotfi Belkacem, Hugues Aubry (1998), « Au delà de la VaR, vers une nouvelle mesure du risque en gestion de portefeuille », Analyse financière, 115.
61. Bart Cocks, Buino Van Der Linden et Adel Karaa (1998) «Active labour market policies and job tenure » Oxford Economic Papers, Vol 50, N°4.
62. Abdeljelil Farhat, Lucien Gardiol, Lynda Khalaf (1998) « Simulation – based finite sample normality tests in linear regressions » Econometric Journal, vol11, p 1 – 20.

63. Ali Gannoun, A.Berlinet, E.Matzner-lober (1998) « Normalité asymptotique d'estimateurs convergents du mode conditionnel » *The Canadian Journal of Statistics*, 26, n° 2, p 365-380.
64. Ali Gannoun, A.Berlinet, E.Matzner-lober (1998) « Propriétés asymptotiques d'estimateurs convergents des quantiles conditionnels » *C.R.A.S*, 326, série I, p 611-614
65. Mela, Carl F., Kamel Jedidi, and Douglas Bowman (1998), « The Long Term Impact of Promotions on Consumer Stockpiling » *Journal of Marketing Research*, 35, 2 (May), p 250-262.
66. Mela, Carl F., Sunil Gupta, and Kamel Jedidi (1998) « Assessing Long Term Promotional Influences on Market Structure » *International Journal of Research in Marketing* , 15, 2 (May), p 89-107.
67. Jamel Trabelsi, Catherine Marcadier (1998) « Causalité transitoire et persistance sur données de panel : Application à l'étude de causalité entre les dépenses et les recettes des communes françaises » *Journées des S.E.S.A.M.*, Montpellier, septembre 1998
68. Jamel Trabelsi (1998) « Le rôle des chocs monétaires dans l'explication du taux de chômage en Allemagne » *Journée de macro-économie à Marseille*, 15 et 16 mai 1998

Année 1997

69. Lotfi Belkacem (1997) « ?-SDE and option pricing model. In *Fractals in Engineering* » edited by Jacques Lévy, Lévy- Vehel, Evelyne Lutton and Claude Tricot , London, Springer- Verlag. 1997
70. Abderrazak Ben Maatoug (1997) « Comportement d'Epargne et Test de Neutralité de la Dette Publique : Analyse par la Cointégration » *Revue Tunisienne d'Economie de Gestion*, Vol. 16.
71. Ali Gannoun, J D. De Gooijer, E.Matzner-lober, (1997) « Nonparametric Forecasting : A comparison of three kernel-based methods » *Communications in statistics, theory and methods*, 27, 6, p 1593-1617.
72. Abdelfattah Triki (1997) « The Development of a Scale For Perceived Product Instrumentality Measurement » *Proceedings of the Annual Academy of Marketing Conference*, Manchester.

73. Kamel Jedidi, S. Jagpal Harsharanjeet, Wayne S. Desarbo (1997) « Finite-Mixture Structural Equation Models For Response-Based Segmentation and Unobserved Heterogeneity » *Marketing Science*, 16, no.1 p 39-59
74. Sami Khedhiri (1997) « Estimation and Testing For Structural Change in Cointegration », *Annales d'Economie et de Gestion*, F.S.E.G.T.
75. Jamel Trabelsi (1997) « Les tests de racine unitaires et le modèles ARCH : application au taux de chômage » *Economie et Prévision*, vol 5, n°131

Année 1996

76. Mohamed Bechri (1996) « Etude stratégique N° 8 sur la compétitivité extérieure de l'économie Tunisienne », IEQ.
77. Kamel Jedidi, Rajeev Kohli, Wayne S. Desarbo. (1996) « Consideration Sets in Conjoint Analysis » *JMR, Journal of Marketing Research*, 33, no.3, (Aug 1996) p 364-372
78. Jedidi, K., V. Ramaswamy, Wayne S. DeSarbo, and Michel Wedel (1996) « On Estimating Finite Mixtures of Multivariate Regression and Simultaneous Equation Models » *Structural Equation Modeling*, 3, p266-289.
79. Adel Karaa (1996) « Estimation des anciennetés de chômage dans un modèle de participation au marché du travail à deux états » *Colloque International économétrie de chômage*, Goteborg -Sweden, 1996.
80. Mohamed Kriaa (1996) « Mobilité et revenu ; Estimation d'un modèle à deux régimes et sélectivité », *Recherche économique de Louvain*.
81. Mohamed Kriaa (1996) « Mobilité géographique de l'insertion professionnelle : Approche gravitationnelle », *Revue d'Economie Régionale et Urbaine*
82. Chokri Slim (1996) « Forecasting non linear time series with feed back forward correction networks » *Proceedings for the 16th symposium on forecasting*, Istanbul 1996
83. Abdelwahed Trabelsi (1996) « On the benchmarking approach to forecast combination » *Proceeding of the 16th symposium on forecasting*, Istanbul 1996

Année 1995

84. Wayne S. DeSarbo, Kamel Jedidi (1995) « The Spatial Representation of Heterogeneous Consideration Sets » *Marketing Science*, 14, no.3, (Summer 1995) p 326-342
85. Wayne S. DeSarbo, Kamel Jedidi (1995), « A Latent Structure Tobit MDS Model: An Application to Consideration Set Modeling » *Marketing Science*, 14, p 326-342.
86. Wayne S. De Sarbo, R. Libby, Kamel Jedidi (1995) «CATSCAL : A New Multidimensional Scaling Methodology for the Analysis of Stimulus Categorization » *Computational Statistics &Data Analysis*, 36, p 27-45.
87. Adel Karaa , Jean Michel Plassard (1995) « Disparités spatiale et sectorielle des anciennetés de chômage en Tunisie », Réseau Analyse Economique et Développement, Deuxième journées scientifiques, Rabat 1995

Année 1993

88. Abderrazak Ben Maatoug, A. Scannavino (1993) « Application de la Théorie Ergodique du Chaos en Finance : Analyse des Séries Temporelles», Institut de Statistique de Paris, Université de Paris VI.
89. Abdeljelil Farhat (1993) « Les secteurs clés de l'économie tunisienne », Revue Tunisienne d'Economie et de Gestion.
90. Jamel Trabelsi (1993) « L'étude du comportement du taux de change dans un modèle monétariste » Journée du B.E.T.A.

Année 1992

91. Jamel Trabelsi, Jacques Luzi (1992) «l'instabilité de la détermination du taux de change dans un modèle monétariste » *Economie et Prévision*, vol 3, N° 104.
92. Jamel Trabelsi (1992) « Non-Dichotomie dans un modèle monétariste en économie ouverte » Séminaire Général du G.R.E.Q.E.

Année 1991

93. Adel Karaa, Jean Michel Plassard, Chokri Abdenadher (1991) «Dualisme salarial en Tunisie : Essai d'Identification », *Annales de l'université des sciences sociales de Toulouse*, Tome XXXIX.

Année 1990

94. Sami Khedhiri (1990) « Regulation of the U.S. Natural Gas Industry » Economic Directions, Californie, Spring, vol 3, n°4.
95. Abdelwahed Trabelsi , S.C Hillmer (1990) « Benchmarking Time Series with Reliable Benchmarks » Applied Statistics, 39, No 3, p 367-379.

Année 1989

96. Abdelwahed Trabelsi , S.C Hillmer (1989) « A benchmarking approach to forecast combination » JBES, 7, N 3, p 353-362.

Année 1987

97. Abdelwahed Trabelsi , S.C Hillmer (1987) "Benchmarking of economic time series", JASA, Theory and methods, 82, N 400, p 1064-1071.

7.3.2 Working Papers

1. **Working Paper n°99/1** : Abdelwahed Trabelsi, Aziz Chouikh, « Modeling Risk Premia as Unobservables and Endogenizing Them via Observed Variables: A Stock Market and Forward Foreign Exchange Market Study »
2. **Working Paper n°99/2** Jean- Marie Dufour, Abdeljelil Farhat et Abdelwahed Trabelsi «Tests of serial independence based on simulations »
3. **Working Paper n°99/3** Abdelwahed Trabelsi, Siwar Mehri «Validation empirique de l'hypothèse de la parité des Pouvoirs d'achat sur le contexte tunisien: une approche par la cointégration »
4. **Working Paper n°99/5** : Abdelwahed Trabelsi, Sami Gharbi, «Modélisation ARIMA et GARCH : Cas de la Volatilité des Rendements de l'Indice BVMT »
5. **Working Paper n°99/6** : Abdelwahed Trabelsi, Aziz Chouikh , « Testing whether the Forward Risk Premium Is an Observed or Unobserved Signal »
6. **Working Paper n°99/7** : Abdelwahed Trabelsi, Aida Kammoun, «Modélisation des Taux de Change Effectifs Réels : Expression du Degré de Compétitivité d'un Pays »
7. **Working Paper n°99/9** Chokri Mamoghli , Hager Kossentini Ariguib « Stabilisation des recettes d'exportation des produits de base dans les pays en développement : couverture par les contrats à terme ».

8. **Working Paper n°00/1** : Abdelwahed Trabelsi, Inès Khémir , « Seasonal Periodic Long Memory Modeling for Inflation rates »
9. **Working Paper n°00/2**: Abdelwahed Trabelsi, Lamia Hajjeji, « Les Déviations Empiriques du MEDAF »
10. **Working Paper n°00/3**: Aida Kammoun, Chokri Mamoghli et Abdelwahed Trabelsi «Dynamique d'évaluation des taux de change effectifs réels : expression du degré de compétitivité d'un pays ».
11. **Working Paper n°00/4**: Bergaoui Néjla, Abdelwahed Trabelsi «The Tunisian stock market responses to macroeconomic announcements ».
12. **Working Paper n°00/5**: Sami Gharbi, Abdelwahed Trabelsi « Volatilité boursière et volatilité macroéconomique : cas de l'indice BVMT »
13. **Working Paper n°00/06** : Abdelwahed Trabelsi, Mohamed Saidane, « L'Inflation dans l'Economie Tunisienne : une Analyse Dynamique et Multivariée »
14. **Working Paper n°00/07** Abdelwahed Trabelsi, Amor Oueslati « The Dynamics Of Stock Price Adjustments To New Information : Empirical Evidence From The Tunisian Stock Exchange Market »
15. **Working Paper n°00/09** Abdelwahed Trabelsi Leila Hedhli « A benchmarking Approach to temporal disaggregation of economic time series by related series »
16. **Working Paper n°00/10** : Abdelwahed Trabelsi, Faten Zoghلامي, « Impact des Imperfections des Marchés des Capitaux sur le Comportement d'Investissement des Firmes Tunisiennes »
17. **Working Paper n°00/11** Chokri Slim « A Stochastic Neutral Network Based Extended Kalman Filter for Forecasting Non Linear Time Series ».
18. **Working Paper n°00/12** Chokri Slim « Neutral Net for Chaotic System: a new approach».
19. **Working Paper n°00/13** Chokri Mamoghli, Wejda Ochi « L'Emergence Des Marchés Dérivés a-t-elle Un Effet Sur La Volatilité Des Rendements Des Actifs Sous-jacents?»
20. **Working Paper n°00/14** : Abdelwahed Trabelsi, Karima Ouederni, « Marchés Emergents : Rendements et Volatilité »

21. **Working Paper n°00/15** : Abdelwahed Trabelsi, Walid Derbel, «Les Sources et Les Déterminants du Différentiel de Salaire »
22. **Working Paper n°00/16** : Lotfi Belkacem , Hugues Aubry « Hedging Model of Extreme Values and Mutualisation of Risk in Emerging Markets ».
23. **Working Paper n°00/18** : Lotfi Belkacem , Hugues Aubry « Empirical analysis on Scaling in Financial emerging markets».
24. **Working Paper n°02/03** : Chokri Mamoghli, Sameh Kamergi « The forward exchange rate unbiasedness hypothesis : comparative study »
25. **Working Paper n°02/05** : Sami Gharbi « Réaction de la volatilité boursière aux annonces macro-économiques : cas de la bourse de Paris »
26. **Working Paper n°02/06** : Mohamed Saïdane, Abdelwahed Trabelsi « modélisation et prévision de la dynamique inflationniste en Tunisie : une approche multivariée basée sur la cointégration »
27. **Working Paper n°02/07** : Mounira Ben Arab, Nadia Ben Sedrine « L'effet de la relation d'agence sur la politique de dividende des entreprises tunisiennes »
28. **Working Paper n°03/01** : Souhir Hedfi, Abdelwahed Trabelsi «design of an hybrid recommender system : personalization, evaluation and prediction »
29. **Working Paper n°03/03** : Ons Ben Romdhane, Abdelwahed Trabelsi « optimizing Multilayer Perceptrons for time series prediction »
30. **Working Paper n°03/05** : Abderrazzak Ben Maatoug, Wided Zarrouk « Analysing Futures markets by fractionally cointegrated models »
31. **Working Paper n°03/06** : Adel Boughrara « On the conduct of the monetary policy in Tunisia : strengths, weaknesses and operational guidelines »
32. **Working Paper n°03/07** : Hafedh El Ayeche, Abdelwahed Trabelsi « Les réseaux de neurones artificiels pour prévision du trafic aérien de passagers »
33. **Working Paper n°03/08** : Bechir Raggad, Abdelwahed Trabelsi « Value at risk et prévision de la volatilité d'un panier de taux de change »

7.3.3 Livres publiés

1. Chokri Mamoghli, Slaheddine Hellara et Dorra Gatti (1999) « Finance des marchés », Edition C.L.E.
2. Abderazek Ben Maatoug (2001) « Prise de décision par Inférence: Cours de Statistique »
3. Abdelfattah Triki (2001) « Basic Marketing»

7.3.4 Livres en cours

1. Abdelfattah Triki « Consumer Behaviour : Concepts and Applications »
2. Abdelfattah Triki « Advanced Marketing »

8. Perspectives

- ? Renforcer la coopération internationale (augmenter le nombre de partenaires et viser les grands projets) pour la formation diplômante et la recherche.
- ? Organisation du colloque des journées doctorales avec la participation des universités françaises.
- ? Mettre en place des projets avec des entreprises et organismes nationaux.
- ? Organisation d'un 2^{ème} colloque international sur l'économie de l'environnement.
- ? Organisation d'un colloque sur la modélisation et la prévision des phénomènes économiques et financiers.
- ? Soumission du projet portant sur la démographie économique :
 - Vieillesse démographique, son intensité et son calendrier
 - Transferts intergénérationnels et problèmes d'équité
 - Inégalités et cohésion sociales, mesures et impacts sur le développement
- ? Elaboration d'un portrait social de la Tunisie à l'horizon 2050.

- ? Elaboration d'un portrait démographique de la Tunisie 2050.
- ? Elaboration d'un système informatique de Veil stratégique (Prévision à moyen et long terme) et de surveillance conjoncturelle (à court terme).
- ? Renforcer le développement de cours avec support Multimédia.

9. Tableau récapitulatif des productions scientifiques

Productions Scientifiques	Observations	
	Nombre	Spécialité
DEA Soutenus	28	Modélisation : 13 ; Informatique : 3 ; Gestion : 12
Thèses soutenues	4	Gestion : 1 ; Modélisation : 3
Thèses en cours	35	Modélisation : 14 ; Informatique : 2 ; Gestion : 19
Thèses achevées (non soutenues)	1	Modélisation
DEA en cours	8	Informatique : 1 ; Prévision : 7
Admis au concours d'assistanat	13	Méthodes quantitatives : 6 ; Gestion : 7
Habilitations soutenues	6	Méthodes quantitatives : 4 ; Finance : 2
Articles publiés	97	
Working papers	33	
Logiciels développés	4	
Séminaires de recherche	13	
Cours sur Intranet		Prévision assistée par ordinateur ; Econométrie ; Statistiques Descriptives ; Statistiques Mathématiques
Livres publiés		Finance des Marchés (Edition C.L.E) Prise de décision par inférence : Cours de Statistique Basic Marketing
Livres en cours		Consumer Behaviour : Concepts and Applications ; Advanced Marketing
Coopération		Séminaire de recherche à l'université Louis Pasteur (Laboratoire Béta) Séminaire de recherche à l'université Aix-Marseille II (Laboratoire GREQAM)
Conférence Internationale		Investment and Financing Decisions : Risk and Value Creation
Colloque International		Modélisation statistique pour l'environnement : Gestion de la qualité de l'air

10. Bilan des dépenses

Bilan des dépenses (arrêté 341) du 28/10/2000

Libellé	Crédit ouvert	Crédit engagé	Dépenses à engager (en cours)	Reste disponible
Equipement	14500	12221.000	10000	2279.000
Consommables	1000	0	1000	0
Missions	6000	5190.000	-	810.000
Colloques et Séminaires	7500	4734.414	-	2765.586
Rémunération	3000	600.000	1500	2400.000
Documentation, Banques donnée	4500	3577.068	4500	922.932
Edition et Maintenance	1500	1468.800		31.200

Bilan des dépenses (arrêté 50) du 27/12/99

Libellé	Crédit ouvert	Crédit engagé	Reste disponible
Equipement	10000	9982.011	17.989
Consommable	3500	3262.848	237.152
Mission	8000	7604.500	395.500
Rémunération	1000	600.000	400.000
Documentation, Banques donnée	2000	1923.518	76.482
Edition et Maintenance	500	374.500	125.500

Bilan des dépenses BESTMOD (1) 28-02-02

Libellé	Crédit ouvert	Crédit engagé	Dépenses à engager (en cours)	Reste disponible
Equipement	15000.000	8921.0000		6079.000
Consommables	3000.000	2884.600		115.400
Missions et titre de transport	20000.000	520.000		19480.000
Stages	2500.000	1500.000		1000.000
Colloques et Séminaires	5000.000			5000.000
Rémunération	3500.000			3500.000
Documentation, Banques donnée	5000.000	325.000		4675.000
Edition et Maintenance	1000.000	250.160		749.840

11. Annexes : synthèse et résultats des travaux de recherche

Annexe 1 : Travaux de recherche en Thèse

Annexe 2 : Travaux de recherche en DEA