

**Jean-Pierre  
Indjehagopian**

**Distinguished  
Emeritus  
Professor,  
Department  
Information  
Systems, Decision  
Sciences and  
Statistics (IDS)**



**Contact**

✉ **Mail:**  
jpi@essec.fr  
✉ Avenue Bernard  
Hirsch.  
BP 50105  
95021 Cergy Pontoise  
cedex  
FRANCE

## Education

Docteur en Statistiques, Université Paris VI.  
DEA en Probabilités, Université Paris VI.  
Diplôme de l'Institut de Statistique de l'Université Paris VI (ISUP).  
Maîtrise de Mathématiques Pures, Université Paris VI.

## Research Areas

Data analysis, statistical modelling, forecasting.

---

## Publications

### ✉ Academic Publications

#### Books

*Statistique pour la gestion.* (with A. Dussaix). 2d edition. Paris (France) : Les Editions d'Organisation, mementos-eo, 1991

#### Articles

"Dynamics of Heating Oil Market Prices in Europe" (F. Lantz), *Energy Economics*, May 2000, Vol. 22, Issue 2

"Purchasing Power Parity Dynamics" (F. Aftalion), *European Economic Review*, Oct 1996

"Mesure d'impact de promotion des ventes : description et comparaison de trois méthodes" (S. Mace), *Recherche et Applications en Marketing*, Jan 1994, Vol. 9, Issue 4, p. 53-79

"Multidimensional Analysis of a Commodity Price System" (J. Cordier), *International Journal of Forecasting*, Jan 1986, Vol. 2, Issue 2

#### Book Chapters

*La méthode Box et Jenkins.* In: *Les prévisions - Performance et prévention - Ordre des Experts Comptables et des Comptables Agréés.* Paris (France) : Editions Comptables Malesherbes, 1986

*Le modèle de régression et son application en prévision.* In: *Les prévisions - Performance et prévention - Ordre des Experts Comptables et des Comptables Agréés.* Paris (France) : Editions Comptables Malesherbes, 1986

### ✉ Working Papers

"La pénétration du diesel en France : tendances et ruptures" (S. Juan, F. Lantz, F. Phiippe). Essec Research Center, DR-01019 May 01.

"Exchange Rate and Medium Distillates Distribution Margins" (F. Lantz, V. Simon). Essec Research Center, DR-98027 Jul 98.

"Dynamique des prix sur le marché des fiouls domestiques en Europe" (F. Lantz, V. Simon). Essec Research Center, DR-98017 Jul 98.

"Purchasing Power Parity Dynamics (Version révisée du numéro 96018)" (F. Aftalion). Essec Research Center, DR-96045 Jul 96.

"Purchasing Power Parity Dynamics" (F. Aftalion). Essec Research Center, DR-96018 Mar 96.

"Etude de l'impact des promotions sur les ventes : méthodes de collecte des données et méthodes d'analyse statistique" (A. Dussaix). Essec Research Center, DR-96009 Feb 96.

"Etude comparative de mesures d'impact de promotion des ventes" (S. Mace). Essec Research Center, DR-94032 Jul 94.

"Var Modelling of Macroeconomic Time Series : Causality and Shock Analysis" (M. Mourad). Essec Research Center, DR-93061 Dec 93.

"Causality and Shock Analysis in the French Industrial Sector" (M. Mourad). Essec Research Center, DR-93010 Feb 93.

"Modélisation des indices de la production industrielle française à partir des processus autorégressifs vectoriels - Etude de la causalité et de la propagation de chocs" (M. Mourad). Essec Research Center, DR-91020 May 91.

"Comparaison des critères AIC, FPE, BIC et HQ pour estimer l'ordre d'un processus vectoriel autorégressif. Application à la production industrielle française" (M. Mourad). Essec Research Center, DR-89003 Jan 89.

"Modélisation VAR de la production industrielle française avec effets ARCH" (JP. Indjehagopian). Essec Research Center, DR-89004 Jan 89.

"Modelling the French Macro Economic Series with VAR Processes" (M. Mourad). Essec Research Center, DR-88010 Jan 88.

"Tests sur le marché financier français de la méthode Value Line" (with O. Dieudonne). Oct 87.

"Tests de causalité par décomposition de fréquences : application à un marché financier" Université de Paris VII, ESSEC, Jul 87.

"Analyse théorique du Timeless Rank calculé par Value Line" (with V. Bertucat, E. Charpentier, O. Dieudonne, F. Renard). ESSEC, Jul 87.

"Trois tests de causalité : test direct de Granger et deux versions du test de Sims modifié" (JP. Indjehagopian). Essec Research Center, DR-86007 May 86.

"Analyse des séries chronologiques et prévisions : la méthode Box et Jenkins" (JP. Indjehagopian). Essec Research Center, DR-86004 Jan 86.

"Le modèle de régression et son application en prévision" (JP. Indjehagopian). Essec Research Center, DR-86005 Jan 86.

## ☞ Other Publications

### Articles published in Conference Proceedings

"Oil Price Volatility: Influence of the Trader's Behaviour on the Term Structure", With C. Ionnidis, F. Lantz. In : *Stock Markets-LXXXIV Colloque*

*International de l'AEA*,. Paris (France) : AEA, 2004

"Apport des méthodes de Bootstrap à un modèle de Translog. Application à la demande", With M. Bourdon, F. Lantz. In : *XXXIV Journées de Statistique (SFdS)*,. Bruxelles & Louvain (Belgique) : Société Française de Statistique (SFdS), 2002

"Analyse économétrique de la part de marché en France des voitures neuves à moteur diesel", With S. Juan, F. Lantz. In : *Actes des XXXIIIèmes Journées de Statistique SFdS*,. Paris (France) : SFdS - Société Française de Statistique, 2001

"Exchange Rate and Medium Distillates Distribution Margins", With F. Lantz, V. Simon. In : *Modelling Energy Markets-LXIVème Colloque*,. Berlin (Allemagne) : Applied Econometrics Association (AEA). Technische Universität Berlin, 1998

"Dynamique des prix sur le marché des fiouls domestiques en Europe", With F. Lantz, V. Simon. In : *Colloque International : Marchés Financiers Emergents*,. Paris (France) : Association d'Econométrie Appliquée (A.E.A.), 1998

"Purchasing Power Parity Dynamics", With F. Aftalion. In : *13th International Conference of the French Finance Association (AFFI)*,. Genève (Suisse) : International Finance Laboratory - Université de Genève - Faculté des Sciences Economiques & Commerciales, 1996, p. 1-30

"Purchasing Power Parity Dynamics". In : *Forecasting Financial Markets - New Advances for Exchange Rates, Interest Rates and Asset Management*,. Londres (Grande-Bretagne) : Chemical Bank, Imperial College, 1996

"Nonlinear Time Series Analysis of Commodity Spot Prices : The Case of COCOA", With D. Guegan. In : *50th Session of the International Statistical Institute (ISI)*,. Pékin (Beijing) (Chine) : Institut International de Statistique, 1995, p. 537-538

"A Study of the Impact of Promotions on Sales : Data Collection and Statistical Analysis Methods", With A. Dussaix. In : *Bulletin de l'Institut International de Statistique (Bulletin of the International Statistical Institute)*,. Pékin (Beijing) (Chine) : Institut International de Statistique, 1995, p. 309-310

---

## Other Activities

### 📌 Scientific Activities

#### Conference Presentations

"Oil and Oil Company Stock Prices: Cointegration with Changing Regimes ", (with F. Declerck). AFFI, 32nd International Conference of the French Finance Association , ESSEC, Cergy , France , 01 Jun 2015

"Oil Price Volatility: Does It Matter Who Trades?", (with C. Ionnidis, F. Lantz). Workshop Econometric Time Series Analysis- Methods and Applications -SFB 10-", Linz, Austria, 29 Sep 2003

"Apport des méthodes de Bootstrap à un modèle de Translog. Application à la demande d'énergie", (with M. Bourdon, F. Lantz). XXXIV Journées de Statistique, Bruxelles et Louvain, Belgique, 13 May 2002

"Modélisation ARCH de la volatilité des marchés financiers", Rencontre autour des Séries Chronologiques, Paris, France, 14 Mar 2002

"Co-intégration en finance - Partie I : Intégration , Partie II : Cointégration", Séminaire Département Finance de l'ESSEC", Cergy-Pontoise, France, 17 Oct 2000

"Tests de cointégration avec rupture : application à l'analyse de la formation des cours mondiaux des produits énergétiques", (with F. Lantz, V. Simon). Deuxième Journée Econométrie Appliquée, Rennes, France, 10 May 1999

"Dynamique des prix sur le marché des fiouls domestiques en Europe", (with F. Lantz, V. Simon). Colloque International : Marchés Financiers Emergents, Paris, France, 11 Jun 1998

"Mobil Telephone Traffic Forecasts", (with S. Mace). 18th International Symposium on Forecasting, Edinburgh, Grande-Bretagne, 10 Mar 1998

"Modélisation du trafic aérien en utilisant une approche linéaire et une approche par réseaux neuronaux", (with S. Mace). XXIXèmes Journées de Statistique, Carcassonne, France, 26 May 1997

"Une étude de cas : les modèles ARCH.", Modèles, Modélisations en sciences physiques & en sciences sociales (Histoire, Epistémologie), Paris, France, 09 Jan 1997

"Modelling of the Impact of the Arrival of a New Means of Transport which is a Rival to the Plane", (with S. Mace). 14th European Conference on Operational Research - EURO XIV, Jerusalem, Israël, 03 Jul 1995

"Etude comparative de mesures d'impact de promotion de ventes", (with S. Mace). 10e Congrès de l'AFM, Paris, France, 10 May 1994

"Comparative Study of Modelling Time Series with Outliers", (with S. Mace). TIMS/ORSA - Joint National Meeting, Boston, USA, 24 Apr 1994

"Cointégration dans le système macroéconomique : production industrielle française", (with M. Mourad). XXIVe Journées de Statistique, Bruxelles, Belgique, 18 May 1992

"Causality Analysis, Effects of Shocks and Forecasting Using Vector Autoregressions in the French Industrial Product Sector", (with M. Mourad). The Eleventh International Symposium on Forecasting, New York, USA, 09 Jun 1991

"Modélisation des indices de la production industrielle française à partir de processus autorégressifs vectoriels - Etude de la causalité et de la propagation de chocs", (with M. Mourad). XXIIIe colloque Structures Economiques et Econométrie, Lyon, France, 23 May 1991

"Processus agrégés et cointégration", Séminaire du Laboratoire de Statistique Théorique et Appliquée (LSTA) de Paris, Paris, France, 20 Mar 1991

"Modélisation VAR de la production industrielle française avec effets ARCH", Congrès de l'Institut de Statistique International, Paris, France, 29 Aug 1989

"Modelling the French Macro Economic Series with VAR Processes", Congrès EURO IX TIMS, Paris, France, 06 Jul 1988

"Séminaire international sur le transport aérien organisé par l'Institut du Transport Aérien", Paris, France, 01 Oct 1987

"Journée sur les processus stochastiques et la prévision", Strasbourg, France, 01 Apr 1987

"Discussion du document de recherche de Gouriéroux, Monfort et Renault intitulé : Mesures de causalité et information de Kullback", Séminaire d'Econométrie de Mr. Edmond Malinvaud, Malakoff, France, 10 Nov 1986

"Les méthodes de prévision à très court terme et court terme : présentation, comparaison et logiciels", 41e Congrès National de l'Ordre des Experts Comptables et Comptables Agréés, Paris, France, 18 Sep 1986

"6th International Symposium on Forecasting", Paris, France, 15 Jun 1986

"Modelling of the Impact of the Arrival of a New Means of Transport Which Is a Rival to the Plane." (with S. Macé) in 14th European Conference on Operational Research - EURO XIV - Association of European Operational Research Societies, Jerusalem (Israël) - July 1995.