Christophe Boucher

cboucher@parisnanterre.fr

Tel. 0140974766

Axe de recherche
Macroéconomie internationale, finance, matières premières et économétrie financière

Thème(s)
Econométrie; Crises financières; Economie financière

HAL: Lien

Présentation

Professeur des universités
http://boucher.univ.free.fr/christophe.html
Université Paris Nanterre,
UFR SEGMI, 200 avenue de la République, 92001 Nanterre cedex, France
Bureau G307 bis
Mobile: 33 6 10 54 17 48

@christopheB52

Documents de travail

HAL: Lien

05/2018 - Stocks and Bonds: Flight-to-Safety for Ever?
Christophe Boucher, Sessi Tokpavi

06/2017 - Testing for Extreme Volatility Transmission with Realized Volatility Measures
Christophe Boucher, Gilles de Truchis, Elena Ivona Dumitrescu, Sessi Tokpavi

Publications

HAL: Lien

2025 - Benoit Begoc, Christophe Boucher, Patrick Kouontchou, Sessi Tokpavi. Sustainable Multi-Manager Portfolio Optimization under Factor Model Uncertainty. Journal of portfolio management, 2025, 52 (3), pp.255-279. (10.3905/jpm.2025.1.790). (hal-05505171)
https://hal.science/hal-05505171v1

2025 - Christophe Boucher, Wassim Le Lann, Stéphane Matton, Sessi Tokpavi. Are ESG Ratings Informative To Forecast Idiosyncratic Risk?. Finance, 2025, 46 (1), pp.81-129. (10.3917/e.fina.pr.035). (hal-05408497)
https://hal.science/hal-05408497v1

2023 - Christophe Boucher, Wassim Le Lann, Stéphane Matton, Sessi Tokpavi. Are ESG ratings informative to forecast idiosyncratic risk?. 2024. (hal-04140193v3)
https://hal.science/hal-04140193v3

2021 - Patrick Kouontchou, Christophe Boucher. Search for Yield and the Global Covid Crisis: the Phantom Systemic Crisis. Revue d'économie financière, 2021, N° 142 (2), pp.229-252. (10.3917/ecofi.142.0229). (hal-03526219)
https://hal.science/hal-03526219v1

2021 - Christophe Boucher, Alexandre Jasinski, Patrick Kouontchou, S. Tokpavi. Smart Alpha: active management with unstable and latent factors. Quantitative Finance, 2021, 21 (6), pp.893-909. (10.1080/14697688.2020.1868558). (hal-03676583)
https://univ-orleans.hal.science/hal-03676583v1

2021 - Christophe Boucher, Sessi Tokpavi, Patrick Kouontchou, Alexandre Jasinski. Smart Alpha: active management with unstable and latent factors. Quantitative Finance, 2021. (hal-03130957)
https://hal.science/hal-03130957v1

2021 - Christophe Boucher, Patrick Kouontchou. Quête de rendements et crise Covid-19 : la crise systémique fantôme. Revue d'économie financière, 2021. (hal-03130958)
https://hal.science/hal-03130958v1

2020 - Christophe Boucher, Catherine Lubochinsky, Salima Ouerk. Unconventional monetary policy in the Euro Area: Shadow rate and light effets. Journal of Macroeconomics, 2020. (hal-03130956)
https://hal.science/hal-03130956v1

2020 - Christophe Boucher. Les projets de réforme du SMI. Le régne du dollar, La documentation française, 2020. (hal-03155686)
https://hal.science/hal-03155686v1

2019 - Christophe Boucher, Sessi Tokpavi. Stocks and bonds: Flight-to-safety for ever?. Journal of International Money and Finance, 2019, 95, pp.27-43. (10.1016/j.jimonfin.2019.03.002). (hal-03676595)
https://univ-orleans.hal.science/hal-03676595v1

2019 - Christophe Boucher, Sessi Tokpavi. Stocks and Bonds: Flight-to-Safety for Ever?. Journal of International Money and Finance, 2019. (hal-02067096)
https://hal.science/hal-02067096v1

2018 - Christophe Boucher, Sessi Tokpavi. Stocks and Bonds: Flight-to-Safety for Ever?. 2018. (hal-04141705)
https://hal.science/hal-04141705v1

2017 - Christophe Boucher, Gilles de Truchis, Elena Ivona Dumitrescu, Sessi Tokpavi. Testing for Extreme Volatility Transmission with Realized Volatility Measures. 2017. (hal-04141651)
https://hal.science/hal-04141651v1

2015 - Christophe Boucher, Boucher Christophe, Catherine Lubochinsky. Déséquilibres globaux et crise globale : quel partage des risques avec des assureurs en dernier ressort. Revue d'économie financière, 2015, 119. (hal-01449955)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01449955v1

2015 - Christophe Boucher. Monnaies, taux de change et déséquilibres financiers. Problématiques économiques, La Documentation française, 2015. (hal-01410775)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01410775v1

2015 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. La macroéconomie-en-risque. Revue Economique, 2015, 66 (4), pp.769--782. (10.3917/reco.pr2.0045). (hal-01243400)
https://univ-reunion.hal.science/hal-01243400v1

2015 - Christophe Boucher, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Du risque des mesures de risque systémique. Revue Economique, 2015, 67 (2016/02), pp.263 - 278. (10.3917/reco.pr2.0065). (hal-01243404)
https://univ-reunion.hal.science/hal-01243404v1

2015 - Christophe Boucher, Michel Boutillier, Vincent Bouvatier, Patrick Kouontchou, Ursula Szczerbowicz. Introduction : Risque systémique et politiques macro/micro prudentielles. Revue Economique, 2015, 66 (3), pp.469 - 480. (10.3917/reco.663.0469). (hal-01371742)
https://hal.univ-lorraine.fr/hal-01371742v1

2015 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. La macroéconomie-en-risque. Revue Economique, 2015, 66. (hal-01386001)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386001v1

2014 - Christophe Boucher, Jon Danielsson, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Risk Model-at-Risk. Journal of banking & finance = Journal of banking and finance, 2014, 44. (hal-01386003)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386003v1

2014 - Christophe Boucher, Jón Daníelsson, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Risk models-at-risk. Journal of banking & finance = Journal of banking and finance, 2014, 44, pp.72--92. (10.1016/j.jbankfin.2014.03.019). (hal-01243413)
https://univ-reunion.hal.science/hal-01243413v1

2014 - Christophe Boucher. La finance mondiale : maîtrisée ou porteuse de nouvelles crises ?. Comprendre l'économie mondiale, La Documentation française, 2014. (hal-01410776)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01410776v1

2013 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Learning by Failing : A Simple VaR Buffer. Financial Markets, Institutions and Instruments, 2013, 22 (2), 113-127 p. (10.1111/fmii.12006). (hal-02312335)
https://hal.science/hal-02312335v1

2013 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Tijd voor revisie van Life-Cycle fondsen. VBA Journaal, 2013, 29 (113), 28-32 p. (hal-02312337)
https://hal.science/hal-02312337v1

2013 - Christophe Boucher, Gregory Jannin, Bertrand Maillet, Patrick Kouontchou. An Economic Evaluation of Model Risk in Long-term Asset Allocations. 2013. (halshs-00825303)
https://shs.hal.science/halshs-00825303v1

2013 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Learning by Failing: A Simple VaR Buffer. Financial Markets, Institutions and Instruments, 2013, 22 (2), pp.113--127. (10.1111/fmii.12006). (hal-01243425)
https://univ-reunion.hal.science/hal-01243425v1

2013 - Hélène Raymond, Christophe Boucher. Les bulles spéculatives. Les Systèmes financiers. Mutations, Crises et Régulation, Econonomica, 2013. (hal-01648614)
https://hal.science/hal-01648614v1

2013 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Learning by Failing: A Simple Buffer for VaR. Financial Markets, Institutions and Instruments, 2013, 22. (hal-01386005)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386005v1

2013 - Christophe Boucher, Hélène Raymond. Les crises bancaires et financières. Les systèmes financiers : Mutations, crises et régulation, Economica, 2013. (hal-01410688)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01410688v1

2013 - Bertrand Maillet, Christophe Boucher. Tijd voor revisie van Life-Cycle Fondsen. VBA Journal, 2013, Spring, pp.28--32. (hal-01243424)
https://univ-reunion.hal.science/hal-01243424v1

2013 - Christophe Boucher, Gregory Jannin, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. An Economic Evaluation of Model Risk in Long-term Asset Allocations.. Review of International Economics, 2013, 21 (3), pp.475 - 491. (10.1111/roie.12049). (hal-01369201)
https://hal.science/hal-01369201v1

2013 - Christophe Boucher. Un aperçu des innovations et pratiques financières au cœur des polémiques. La finance mise au pas ?, La Documentation française, 2013. (hal-01410777)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01410777v1

2013 - Christophe Boucher. les crises boursières. Encyclopédie Universalis, Universalis, 2013. (hal-01410779)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01410779v1

2012 - Christophe Boucher, Gunther Capelle-Blancard, Jézabel Couppey-Soubeyran, Olena Havrylchyk. Quand la finance ne sert plus la croissance. CEPII. L'économie mondiale 2013, La Découverte, pp.78-90, 2012, Repères n°604, 9782707174444. (hal-00854058)
https://hal.science/hal-00854058v1

2012 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Prévoir sans persistance. Revue Economique, 2012, 63 (3), pp.581-590. (10.3917/reco.633.0581). (hal-00820714)
https://hal.science/hal-00820714v1

2012 - Christophe Boucher, Benjamin Hamidi, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Une évaluation économique du risque de modèle pour les investisseurs de long terme. Revue Economique, 2012, 63 (3), pp.591-600. (10.3917/reco.633.0591). (hal-00820721)
https://hal.science/hal-00820721v1

2012 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Prévoir sans persistance. 2012. (halshs-00662771)
https://shs.hal.science/halshs-00662771v1

2012 - Christophe Boucher, Benjamin Hamidi, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Une évaluation économique du risque de modèle pour les investisseurs de long-terme. 2012. (halshs-00825337)
https://shs.hal.science/halshs-00825337v1

2012 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Prévoir sans persistance. Revue Economique, 2012. (hal-01386006)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386006v1

2012 - Christophe Boucher, Gunther Capelle-Blancard, Jézabel Couppey Soubeyran, Olena Havrylchyk. Quand la finance ne sert plus la croissance. L'économie Mondiale 2013, La Découverte, 2012. (hal-01410780)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01410780v1

2012 - Christophe Boucher, Benjamin Hamidi, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Une évaluation économique du risque de modèle pour les investisseurs de long-terme. Revue Economique, 2012. (hal-01386007)
https://hal.parisnanterre.fr/hal-01386007v1

2012 - Christophe Boucher, Benjamin Hamidi, Patrick Kouontchou, Bertrand Maillet. Une evaluation economique du risque de modele pour les investisseurs de long terme. (An Economic Evaluation of the Model Risk for Long-Term Investors. With English summary.).. Revue Economique, 2012, 63 (3), pp.591 - 600. (hal-01380667)
https://hal.science/hal-01380667v1

2011 - Christophe Boucher. Les fonds d'investissement. Les Cahiers français : documents d'actualité, 2011, Les Cahiers français n°361, 361, pp.59-63. (hal-00638907)
https://hal.science/hal-00638907v1

2011 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Detrending Persistent Predictors. 2011. (halshs-00587775)
https://shs.hal.science/halshs-00587775v1

2011 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. The Riskiness of Risk Models. 2011. (halshs-00587779)
https://shs.hal.science/halshs-00587779v1

2011 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Une analyse temps-fréquences des cycles financiers. 2011. (halshs-00565229)
https://shs.hal.science/halshs-00565229v1

2011 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet. Une analyse temps-fréquence des cycles financiers. Revue Economique, 2011, 62 (3), pp.441-450. (10.3917/reco.623.0441). (hal-00755499)
https://hal.science/hal-00755499v1

2009 - Christophe Boucher, Hélène Raymond. Les bulles spéculatives. Christian de Boissieu. Les Systèmes financiers. Mutations, crises et régulation. 3e édition, Economica, pp.71-89, 2009. (hal-00638912)
https://hal.science/hal-00638912v1

2009 - Christophe Boucher, Hélène Raymond. Les crises bancaires et financières. Christian de Boissieu. Les Systèmes financiers. Mutations, crises et régulation. 3e édition, Economica, pp.90-106, 2009. (hal-00638910)
https://hal.science/hal-00638910v1

2008 - Christophe Boucher, Bertrand Maillet, Thierry Michel. Do misalignments predict aggregated stock-market volatility?. Economics Letters, 2008, 100 (2), pp.317-320.

(10.1016/j.econlet.2008.02.019). (hal-00307783)
https://hal.science/hal-00307783v1

2008 - Christophe Boucher, Sofiane Aboura. Testing the fed and the Graham & Dodd models: asymmetric vs. symmetric adjustment. Applied Economics Letters, 2008, 15 (2), pp.91-94. (10.1080/13504850600706693). (hal-00267993)
https://hal.science/hal-00267993v1

2008 - Christophe Boucher, Armand Derhy. La grande modération et la valorisation des actions. Revue d'économie politique, 2008, 118 (5), pp.683-709. (hal-00649156)
https://hal.science/hal-00649156v1

2007 - Christophe Boucher. La réduction de la prime de risque: le rôle du risque macroéconomique. Banque & Marchés, 2007, 87, pp.Mars-avril. (hal-00267995)
https://hal.science/hal-00267995v1

2007 - Christophe Boucher. Asymmetric adjustment of stock prices to their fundamental value and the predictability of US stock returns. Economics Letters, 2007, 95, pp.June, 339-347. (hal-00267994)
https://hal.science/hal-00267994v1

2006 - Christophe Boucher. Le «modèle de la Fed» et la prévisibilité des rentabilités: Sur un malentendu ça pourrait marcher .. Banque & Marchés, 2006, 85, pp.17-27. (hal-00268119)
https://hal.science/hal-00268119v1

2006 - Christophe Boucher. Stock prices–inflation puzzle and the predictability of stock market returns. Economics Letters, 2006, 90, pp.205-212. (hal-00268110)
https://hal.science/hal-00268110v1

2006 - Christophe Boucher. Stock Prices, Inflation and Stock Returns Predictability. Finance, 2006, 27(2), pp.71-102. (hal-00268107)
https://hal.science/hal-00268107v1

2006 - Christophe Boucher. Le régime de croissance patrimonial américain à la lumière d'une crise. Thierry Pouch. La politique économique :mondialisation et mutations, L'harmattan, pp.xx-xx, 2006, Recherches Economiques. (hal-00311103)
https://hal.science/hal-00311103v1

2003 - Christophe Boucher. LA VALORISATION DES SOCIETES DE LA NOUVELLE ECONOMIE PAR LES OPTIONS REELLES : VERTIGES ET CONTROVERSES D'UNE ANALOGIE. Revue d'économie financière, 2003, n°72, pp.299-316. (hal-00268127)
https://hal.science/hal-00268127v1