

## CURRICULUM VITAE

Nom: Bruno Feunou  
Citoyenneté: Canadien  
Langues: Bangam, Bandjoun, Français, Anglais  
Adresse: Duke University  
Department of Economics  
213 Social Sciences Building  
Durham, NC 27708, US  
Telephone: 1 919 660-1814  
Fax: 1 919 684-8974  
E-mail: [bruno.feunou@duke.edu](mailto:bruno.feunou@duke.edu)  
Sites Web: <http://kamkui.net/>  
<http://fds.duke.edu/db/aas/Economics/faculty/bruno.feunou>

### CHAMP DE SPÉCIALISATION

- Économie financière.
- Économétrie financière.
- Économétrie.

### EDUCATION

- Doctorat en économie, Université de Montréal, Canada, Juillet 2009.
- Ingénieur Statisticien Économiste, ENSEA, Abidjan, Côte d'Ivoire, Juin 2003.
- Licence en Mathématiques, Université de Yaoundé, Cameroun Juin 2000.

### COMITE DE THESE DE DOCTORAT

- Directeur: Nour Meddahi, Toulouse School of Economics, France.
- Co-directeur: René Garcia, EDHEC Business School, France.
- Examineur: Christian Gouriéroux, University of Toronto, Canada.
- Membres: Peter Christoffersen, McGill University, Canada.

### ACTIVITES PROFESSIONNELLES

- Chercheur associé, Duke University, United States, Juillet 2008 – Présent.
- Chargé de cours, Duke University, United States, Hiver 2009, Hiver 2010.
- Auxiliaire d'Enseignement, Université de Montréal, Canada, Hiver 2006.
- Auxiliaire d'Enseignement, Université de Montréal, Canada, Automne 2005.

- Assistant de Recherche, CIRANO et CIREQ, Montréal, Canada, 2004 – 2006.
- Stagiaire, Commission Economique des Nation Unis pour l’Afrique, Addis Ababa, Ethiopie, Eté 2002.

## **BOURSES ET DISTINCTIONS**

- Liste d’honneur de la doyenne de la faculté des études supérieures et postdoctorales de l’Université de Montréal, 2009-2010.
- Bourse de Recherche, CREST, Paris, France, 2007.
- Bourse de Doctorat, Institut de Finance Mathématique de Montréal (IFM2), Canada, 2006 – 2008.
- Bourse de Doctorat, Banque Laurentienne, Canada, 2005-2006.
- Bourse de Doctorat, CIREQ, Département d’économie, Université de Montréal, Canada, 2003 – 2006.
- Bourse d’Étude, Union Européenne, ENSEA, Abidjan, Cote d’Ivoire, 2000 – 2003.
- Bourse d’Étude, Ministère des Finances, ISSEA, Yaoundé, Cameroun, 1998 – 2000.
- Bourse, Ministère de L’enseignement Supérieur, University of Dschang, Cameroun, 1997-1998.

## **ARTICLES DANS DES REVUES AVEC COMITE DE LECTURE**

- Peter Christoffersen, Redouane Elkamhi, **Bruno Feunou** et Kris Jacobs (2009) Option Valuation with Conditional Heteroskedasticity and Non-Normality. **Review of Financial Studies**. 23: 2139-2183.

## **ARTICLES EN REVISION DANS DES REVUES AVEC COMITE DE LECTURE**

- **Bruno Feunou** (Juin 2009) A No-Arbitrage VARMA Term Structure Model with Macroeconomic Variables. **En revision dans The Journal of Econometrics**.
- **Bruno Feunou**, Jahan-Parvar Mohammad et Romeo Tedongap (Mars 2010) “Modeling Market Downside Volatility,” Duke University, et Stockholm School of Economics. **En revision dans the Journal of Financial and Quantitative Analysis**.

## **AUTRES CONTRIBUTIONS AVEC COMITE DE LECTURE (COMMUNICATION)**

1. **Bruno Feunou** et Nour Meddahi . Realized term structure of risk.
  - Workshop on realized Variance, Imperial College, London, UK. , (Février 2007): Conférence Régionale organisée par Imperial College, London.

- Conference on Volatility and High Frequency Data, Chicago, US, (Mars 2007) :  
Conférence Internationale organisée par le département de statistique de l'université de Chicago.
2. Peter Christoffersen, Redouane Elkamhi, **Bruno Feunou** et Kris Jacobs, (Aout 2007)  
Option Valuation with Conditional Heteroskedasticity and Non-Normality.
    - European Economic Association Annual Congress, Budapest, Hungary, 2007:  
Conférence Internationale organisée par l' European Economic Association.
  3. **Bruno Feunou** (Juillet 2007) Regime switching and time variation of conditional Skewness in S&P 500.
    - Econometric Society Annual Congress, Budapest, Hungary: Conférence Internationale organisée par l' European Econometric Society.
  4. **Bruno Feunou** et Nour Meddahi. Generalized Affine Models.
    - Econometric seminar, University of Toulouse, Toulouse, France, 2007.
    - Finance seminar, CREST, Paris, 2007.
    - Finance department, Faculty of administration of Laval University, Québec, Canada, 2007.
    - Annual Meeting, Allied Social Science Associations, New orleans US, Décembre 2007. Conférence internationale organisée par l'Allied Social Science Associations.
    - Seminar, Oxford-man Institute, Oxford University, UK, 2008.
    - Seminar, Board of governors, Washington, US, 2008.
    - Seminar, Duke University, Durham, US, 2008.
    - Finance Seminar, HEC de Montréal, Montréal, Canada, 2008.
    - Seminar, York University, Economics department, Toronto, Canada, 2008.
    - Seminar, Chicago GSB, Statistics and Econometrics Group, Chicago, US, 2008.
    - Financial Econometrics Conference, Tanaka Business School, Imperial College London, UK, Mai 2008, Conférence internationale organisée par Tanaka Business School, Imperial College London.
    - Finance Seminar, University of Maryland, US, 2008.
  5. **Bruno Feunou** et Jean-Sebastien Fontaine. Discrete Choice Term Structure Models: Theory And Applications.
    - Seminar, Bank of Canada, Ottawa, Canada, 2010.
    - Financial Econometrics Conference, Toulouse School of Economics, Toulouse, France. 2010.
    - Seminar, Department of Economics, North Carolina State University, Raleigh, US, 2010.

## **AUTRES CONTRIBUTIONS AVEC COMITE DE LECTURE (DOCUMENTS DE TRAVAIL)**

- **Bruno Feunou**, J-S Fontaine et Romeo Tedongap (Septembre 2008). The Equity, Premium and the Volatility Spread: The Role of Risk-Neutral Skewness,. Document de travail de la Banque du Canada, 2009-20. **Présentée à l'EFA 2009.**

## **AUTRES CONTRIBUTIONS SANS COMITE DE LECTURE (DOCUMENTS DE TRAVAIL)**

- **Bruno Feunou** et Romeo Tedongap (April 2010). A Stochastic Volatility Model with Conditional Skewness. Document de travail Duke University et Stockholm School of Economics.
- **Bruno Feunou**, JS Fontaine, Abderahim Taamouti et Romeo Tedongap (Aout 2009). Equity Premium And The Maturity Structure of Uncertainty. Document de travail Duke University, Bank of Canada, Stockholm School of Economics and University of Carlos III.
- **Bruno Feunou**, Peter Christoffersen, Kris Jacobs et Nour Meddahi (Novembre 2009). The Economic Value of Realized Volatility. Document de travail, Duke University, McGill University and Toulouse School of Economics. **Accepté pour une présentation à l'ESWC 2010.**
- **Bruno Feunou** et JS Fontaine (Aout 2010). Discrete Choice Term Structure Models: Theory And Applications, Document de travail, Duke University et Bank of Canada. **Accepté pour une présentation à la conférence sur les séries temporelles organisée par le NBER-NSF 2010. [JOB MARKET PAPER]**
- **Bruno Feunou** et Ernest Tafolon (Aout 2010). Pricing Multiple conditions contingent claim, Duke University et Université Laval.

## **TRAVAUX DE RECHERCHES EN COURS**

- **Bruno Feunou**, Christian Bontemps et Nour Meddahi (Aout 2007). Testing Distributional Assumptions: The multivariate Case. Document de travail, Duke University et Toulouse School of Economics,
- **Bruno Feunou**, JS Fontaine, Abderahim Taamouti et Romeo Tedongap (Aout 2009). Equity Premium And The Maturity Structure of Uncertainty. Document de travail,

Duke University, Bank of Canada, Stockholm School of Economics and University of Carlos III .

## **CONFERENCES**

### **1. Présentations**

- Financial Econometrics Conference, Toulouse School of Economics, May 2010.
- Financial Econometrics Conference, Toulouse School of Economics, May 2009.
- Financial Econometrics Conference, Montreal, April 2009.
- Financial Econometrics Conference, Imperial College London, May 2008.
- Annual Meeting, Allied Social Science Associations, New Orleans US, January 2008.
- European Economic Association Annual Congress, Budapest, Hungary, July 2007.
- Econometric Society Annual Congress, Budapest, Hungary, July 2007.
- Conference on Volatility and High Frequency Data, Chicago, US, March 2007.

### **2. Discussions**

- Financial Econometric Conference, Montreal, April 2009.
- Financial Econometric Conference, Montreal, May 2009.

## **VISITE DE RECHERCHE**

- Bank of Canada, May 2010.
- Duke University, July 2008-July 2009.
- Stockholm School of Economics, May 2009.
- Toulouse School of Economics, May 2007, May 2009.
- CREST, Paris, 2007.
- Imperial College London, 2006.

## **ARBITRE DANS DES JOURNAUX ACADEMIQUES**

- Journal of Applied Econometrics.
- Journal of Econometrics.
- Journal of Empirical Finance.
- Quantitative Finance.
- The IFAC journal Automatica.

- International Journal of Financial Markets & Derivatives.
- Revue Economique.

### **COURS ENSEIGNES**

- Junior Research Seminar, Duke University, Hiver 2009 (Co-enseigné avec Tim Bollerslev et George Tauchen).
- Time series for Financial Analysis, Hivers 2010.

### **DOCUMENTS DE TRAVAIL DISCUTES LORS DES CONFERENCES**

- The Affine Arbitrage-Free Class of Nelson-Siegel Term Structure Models, par Christensen, Diebold, Rudebusch, Montreal, April 2009.
- Exploring Time-Varying Jump Intensities: Evidence from S&P500 Returns and Options, par Peter Christoffersen, Kris Jacobs, Chayawat Ornthanalai, Financial Econometric Conference, Toulouse School of Economics, May 2009.

### **REFERENCES**

- Prof. Tim Bollerslev, Duke University.
  - ✓ boller@duke.edu.
  - ✓ 1-919-660-1846.
- Prof. Peter Christoffersen, McGill University.
  - ✓ peter.christoffersen@mcgill.ca.
  - ✓ 1-514-398-2869.
- Prof. Kris Jacobs, University of Houston.
  - ✓ kjacobs@bauer.uh.edu.
  - ✓ 1- 713-743-2826.
- Prof. Nour Meddahi, Toulouse School of Economics.
  - ✓ meddahi@cict.fr.
  - ✓ 33-5-61-12-85-63.