

Arthur Thomas



Information personnelles

Né le 5 septembre 1994

A Metz, 57000

website: www.arthurthomas.fr

Email: arthur.thomas@univ-nantes.fr

Num: +33 6 45 50 97 27

ENSAE Paris

Bureau 3098

5 avenue Henry le Chatelier

TSA 26644 - 91764 PALAISEAU Cedex

Position actuelle

Assistant d'enseignement en Informatique

Depuis Sept 2020

École Nationale de la Statistique et de l'Administration Économique (ENSAE), France

Membre affilié CREST-ENSAE

Depuis Mai 2021

Chercheur associé

Depuis Mai 2021

Chaire Économie du Climat

Chercheur associé

Depuis Oct 2017

Chaire Économie du Gaz Naturel

Domaines de spécialité

**Econométrie Bayésienne; Econométrie Non causal; Econométrie Structurel;
Economie de l'énergie; Modèle de prévision**

Formation

Doctorat en Sciences Économiques

16 Oct 2017 - 14 Dec 2020

LEMNA, Université de Nantes, EDGE, France

Qualifié par le CNU section 05 - 2021

- Financement : Allocation de recherche IFPEN/ IFP School
- Titre de la thèse : *The Econometrics of Energy Demand: Identification and Forecast*
- Directeur de thèse : Benoît Sévi (Professeur, Université de Nantes)
- Co-encadrant: Olivier Massol (Associate professor, City, University of London & IFP School)

Jury de thèse:

- Karim Abadir (Professor of Financial Econometrics, Imperial College London, , Rapporteur)
- Derek Bunn (Professor of Decision Sciences, London Business School)
- Dimitris Korobilis (Professor of Econometrics, University of Glasgow, Rapporteur)
- Valérie Mignon (Professeure des Universités, Université Paris Nanterre, Présidente du jury)

Diplôme d'ingénieur-statisticien 2014-2017
École Nationale de la Statistique et de l'Analyse de l'Information (ENSAI), France

Classes préparatoires aux grandes écoles (MP) 2012-2014
Lycée Henry Poincaré (Nancy)

Activité de recherche

Articles publiés:

How are day-ahead prices informative for predicting the next day's consumption of natural gas? Evidence from France, *The Energy Journal* (HCERES: A, CNRS: 1) 2021
avec Olivier Massol et Benoît Sévi

Documents de travail:

Machine learning approach in predicting α -stable noncausal processes
avec Frédéric Logé

A Structural Non-causal VAR Model of the Global Oil Market: the Role of Oil Supply News Shocks 2020
avec Zakaria Moussa

Considering real-time demand to forecast the U.S. natural gas price in real-time: The role of temperature data 2020
avec Benoît Sévi and Zakaria Moussa

The role of expectations in predicting the real prices of oil: a non-causal analysis 2020

Production intermittence in spot electricity markets: a behavioral simulations approach 2019
avec Albert Banal-Estanol, Olivier Massol et Augusto Ruperez Micola

Conférences, Séminaires

2020

- Thé des économètres, Paris, France.
- 37th International Conference of the French Finance Association (AFFI), Nantes, France.
- 19^{ème} Journée d'Économétrie, Développements Récents de l'Économétrie Appliquée à la Finance, EconomiX, Nanterre, France (présentation et discussions).
- 2nd International Conference Environmental Economics: A Focus on Natural Resources, University of Orleans.

2019

- Discutant junior invité au Séminaire doctorant, Université Paris Nanterre, France.
- 13th International Conference on Computational and Financial Econometrics, London, UK.
- INFORMS Annual meeting 2019, Seattle, USA.
- 13th Annual Trans-Atlantic Infraday Conference, Washington, USA.
- 18^{ème} Journée d'Économétrie, Développements Récents de l'Économétrie Appliquée à la Finance, EconomiX, Nanterre, France.(présentation et discussions).
- Séminaire CREST-ENSAI 2019, Rennes, France.
- Thé des économètres, Orléans, France.
- Workshop in Financial Econometrics, Nantes, France.
- The 3rd Commodity Markets Winter Workshop-Leibniz University, Hannover, Germany.
- Workshop EDGE 2019, Rennes, France.
- The 2nd International Conference The Economics of Natural Gas, University Paris-Dauphine, Paris, France.

2018

- 12th International Conference on Computational and Financial Econometrics, Pisa, Italy.
- 41st edition of the IAEE international conference, Groningen, Netherland.
- FAEE summer workshop, Mines ParisTech, Paris, France (présentation et discussions).
- 29th European Conference On Operational Research. Valencia, Spain.
- INFORMS 2018 Annual Meeting Phoenix, USA.
- 11th Annual Trans-Atlantic Infraday Conference, Washington, USA.
- Commodities and Energy Market Organization in the Energy Transition Context, IFP Energies nouvelles, Reuil-Malmaison, France.

Activités de référé

Annals of Economics and Statistics, Energy Journal, Energy Economics, International Economics

Autres responsabilités

- Organisation de conférence:
 - 43rd IAEE International Conference, Paris, France.
 - 37th International Conference of the French Finance Association (AFFI), Nantes, France

- Membre du groupe de travail "Les Jeunes Économètres", Les Jeunes Économètres est un groupe de travail créé en septembre 2016 par Gilles de Truchis et Elena Dumitrescu (Université Paris Nanterre) et Denisa Banulescu (Université d'Orléans) et portant sur l'économétrie des séries temporelles. Il a pour but de réunir les jeunes économètres (doctorants en fin de thèse, post-doctorants et jeunes MCF) de la région parisienne afin de favoriser les collaborations scientifiques et le montage de projets financés. Le groupe se retrouve mensuellement lors d'un séminaire intitulé "thé des jeunes économètres" pour des présentations et discussions sur des questions d'économétrie théorique et appliquée. Il comprend à ce jour 27 membres provenant des Universités Panthéon-Sorbonne, Paris Dauphine, Paris Nanterre, Paris 8, Paris 13, Orléans, Cergy, de Nantes, de l'ENSAE (CREST), de l'ESSEC Business School et de Paris School of Economics.<http://www.varenes-ecofin.com/cje.html>

Références

Benoît Sévi

Professeur des Universités
 Director of LEMNA (EA 4272),
 Université de Nantes
benoit.sevi@univ-nantes.fr
 Tel: +33 (0) 2 40 14 17 96
 LEMNA EA 4272, Université de Nantes
 Chemin de la Censive du Tertre
 Bâtiment Tertre, BP 52231
 44322 Nantes cedex 3
 Website:
<https://sites.google.com/site/benoitsevi/>

Olivier Massol

Associate Professor in Economics
 IFP School
 Center for Economics and Management
 228-232 avenue Napoléon Bonaparte,
 92852 Rueil-Malmaison Cedex, France.
olivier.massol@ifp.fr

Karim Abadir

Professor of Financial Econometrics
 Imperial College
 3.03 53 Prince's Gate
 South Kensington Campus
 London, UK
 E-mail : k.m.abadir@imperial.ac.uk
 Website:
<https://www.imperial.ac.uk/people/k.m.abadir>

Dimitris Korobilis

Professor of Econometrics
 Adam Smith Business School
 University of Glasgow
Dimitris.Korobilis@glasgow.ac.uk
 Tel: +44 (0) 141 330 2950
 University Avenue
 G12 8QQ, Glasgow, UK
<https://sites.google.com/site/dimitriskorobilis/>

Activité d'enseignement

Travaux Dirigés (TD):

Deep Learning: Models and Optimization (6h) Janv 2021
3^{ème} année ENSAE

Cours Magistral (CM):

Économétrie des séries temporelles (18h) Janv 2021
M2-EEET Université Paris-Saclay

Encadrement des enseignements d'informatique

ENSAE Sep 2020

Cours de Python, C++, Éléments logiciels de traitement des données massives,
Introduction à l'algorithmique, Machine learning for finance, etc.

Cours Magistral (CM): Introduction to Python (6h) 2020
3^{ème} année ENSAE

Cours Magistral (CM): Introduction to R (6h) 2020
3^{ème} année ENSAE

Travaux Dirigés (TD): Econometrics (30h) 2019
Pantheon-Sorbonne Master In Economics, Université Paris 1 Panthéon Sorbonne

Travaux Dirigés (TD): Séries temporelles (40h) 2017
Université Paris-Descartes

Divers

Langues Français (Langue Maternelle)
Anglais - TOEIC: 890/990
Allemand- level A2

Compétences

*Informa-
tiques* Java, C++ and C#

*Logiciels
Statistique* Stata, SAS, R, Python, Matlab and Julia: Calcul scientifique sur
supercalculateur