

## CURRICULUM VITAE de Jean JACOD

né le 13 novembre 1944, à Saint-Etienne

**Fonction:** professeur émérite à l'UPMC (Paris-6), membre de l'Institut de Mathématiques de Jussieu

### Carrière:

Ingénieur de l'Ecole Polytechnique en 1965, Ingénieur des Mines en 1968, Doctorat d'Etat, Paris-6, en 1972.

1968-1974: Ingénieur des mines, chercheur à l'Ecole des Mines de Paris au "Centre de Morphologie mathématique".

1973-1974: Post-Doc au département de statistiques de l'université de Princeton.

1974-1983: Professeur à l'Université de Rennes 1.

1983-2009: Professeur à l'UPMC.

### Publications:

Livres: 5

Publications avec comit de lecture: 92

Autres (séminaires, chapitres d'ouvrages collectifs, colloques): 47

### Quelques publications significatives:

J. JACOD, P. PROTTER: Asymptotic error distributions for the Euler method for stochastic differential equations. *Ann. Probab.*, **26**, 267-307 (1998).

J. JACOD: Non-parametric kernel estimation of the diffusion coefficient for a diffusion process. *Scand. J. Statist.* **27**, 83-96 (2000).

E. EBERLEIN, J. JACOD, S. RAIBLE: Lévy term structure models: no-arbitrage and completeness. *Finance and Stochastics*, **9**, 67-88 (2005)

J. JACOD: Asymptotic properties of power variations of Lévy processes. *ESAIM-PS*, **11**, 173-196 (2007).

J. JACOD: Asymptotic properties of realized power variations and associated functionals of semimartingales. *Stoch. Proc. Appl.*, **118**, 517-559 (2008). 129-A

Y. AIT-SAHALIA, J. JACOD: Testing for jumps in a discretely observed process. *Annals of Statistics*, **37**, 1, 184-222 (2009).

J. JACOD, Y. LI, P. MYKLAND, M. PODOLSKIJ, M. VETTER: Microstructure noise in the continuous case: the pre-averaging approach. *Stoch. Proc. Appl.*, **119**, 7, 2249-2276 (2009).

J. JACOD, Z. KOWALSKI, A. NIKEGHBALI: Mod-Gaussian convergence: new limit theorems in probability and number theory. *Forum Math.* **23**, 835-873 (2011).

A. DIOP, J. JACOD, V. TODOROV: Central Limit Theorem for Approximate Quadratic Variations of Pure Jump Itô Semimartingales. *Stoch. Proc. Appl.* **123**, 839-886 (2013).