CURRICULUM VITAE

Nom: ALAIN GUAY

Adresse au travail: Université du Québec à Montréal

Département des sciences économiques Case postale 8888, Succursale Centre-Ville

Montréal (Qc), Canada, H3C 3P8

Téléphone: (Bureau) (514) 987-3000 # 8377

(Fax) (514) 987-8494

(e-mail) guay.alain@uqam.ca

Citoyenneté: Canadienne

Langues: Français, anglais

Formation:

1989-1994 : Doctorat en sciences économiques, Université de Montréal

1988 : Certificat en statistique, Université Laval 1984-1986 : M.Sc. en économie, Université de Montréal 1981-1984 : Baccalauréat en économie, Université Laval.

Expériences professionnelles:

2019 : Cotitulaire de la Chaire en macroéconomie et prévisions,

ESG-UQAM

2004: Professeur titulaire,

Université du Québec à Montréal

1999-2004: Professeur aggrégé,

Université du Québec à Montréal

1996-1999: Professeur associé,

Université du Québec à Montréal

1995: Économiste, Ministère des finances, Canada

Département des études spéciales

1994: Économiste, Banque du Canada

Département des relations internationales

Chercheur et professeur invités:

- Professeur invité: Université Paris Ouest, Nanterre: novembre 2013, octobre 2014, décembre 2015, novembre 2016, octobre 2017, octobre 2018, octobre 2019, octobre 2021, octobre 2021 et octobre 2023.
- Chercheur invité: Toulouse School of Economics (TSE), Université de Toulouse : janvier à juillet 2003, octobre 2004, octobre 2005, octobre 2007, mai 2008, mai 2009, novembre 2010, mai 2012, juin 2013, juin 2014, juin 2015, juin 2016, juin 2017, mai 2018, juin 2019, juin 2022 et juin 2023..
- Chercheur invité: Centre de Recerca en Economia Internacional (CREI), Universitat Pompeu Fabra : septembre 2010 à mai 2011.
- Professeur invité: Paris-I, Panthéon-Sorbonnes: mai 2006.
- Professeur invité: HEC Lausanne: mars 2006, mai 2008 et mai 2009.
- Professeur invité: Université de la Réunion : mars 2008, novembre 2008, mars 2009, mars 2010, mars 2011, mars 2012, mars 2013 et mars 2014.
- Professeur invité: Université des Antilles: mars 2004, mars 2005, février 2006, décembre 2006, janvier 2007, novembre 2007, janvier 2008, janvier 2009, janvier 2010, janvier 2011, décembre 2011, décembre 2012, septembre 2012, décembre 2013, mai 2014, décembre 2014, février 2015, février 2015, mai 2016, décembre 2016, mars 2017 décembre 2017, mars 2018, dcembre 2019, décembre 2021 et janvier 2023.

Publications:

- Guay, A. et F, Pelgrin (2023) "SVARs in the Frequency Domain", *Journal of Econometrics*, à paraître.
- Bec, F., A. Guay, Nielsen, H. B. et S. Saïdi (2023) "Power of unit root tests against nonlinear and noncausal alternatives, with an application to the Brent crude oil price", *Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*, accepté avec révisions mineures.
- Guay, A. (2021), "Identification of Structural Vector Autoregressions Through Higher Unconditional Moments", *Journal of Econometrics*, 225, 27–46.
- Beaudry, P., P. Fève, A. Guay et F. Portier (2019), "When is Nonfundamentalness in SVARs a Real Problem?" (with Paul Beaudry, Patrick Fève et Frank Portier), Review of Economic Dynamics, 30, 221–243.
- Fève, P. et A. Guay (2019), "Sentiments in SVARs", (avec Patrick Fève), *Economic Journal*, 129, 877–896.
- Guay, A. et J.F. Lamarche (2018), "Structural Change Tests for GEL Criteria", Econometric Reviews, 37 (2018), 1000–1032.
- Guay, A. et F. Pelgrin (2016), "Using implied probabilities to improve estimation with unconditional moment restrictions for weakly dependent data", *Econometric Reviews*, 35, 344–372.
- Guay, A. (2016), "Anticipations, bruits et sentiments," L'Actualité Économique: revue d'analyse économique, 92, 621–648.
- Guay, A et A. Maurin (2015), "Disaggregation Methods Based on MIDAS Regression", *Economic Modelling*, 50, 123–172.
- Chaudourne, J., P. Fève et A. Guay, (2014) 'Understanding the Effect of Technology Shocks in SVARs with Long-Run Restrictions", *Journal of Economic Dynamics and Control*, 41, 293–308.
- Guay, A., E. Guerre et S. Lazarova, (2013) "Robust Adaptive Rate-Optimal Testing for the White Noise Hypothesis", *Journal of Econometrics*, 176, 134–145.
- Ambler, S., A. Guay et L. Phaneuf, (2012), "Endogenous Business-Cycle Propagation and the Persistence Problem: The Importance of Labor-Market Frictions." *Journal of Economic Dynamics and Control*, 36, 47–62.

- Guay, A. et J.F. Lamarche (2012), "Structural Change Tests Based on Implied Probabilities for GEL Criteria", *Econometric Theory*, 28, 1186-1228.
- Fève, P. et A. Guay (2010), "Identification of Technology Shocks in Structural VARs", *Economic Journal*, 120, 1284–1318.
- Fève, P. et A. Guay (2009), "The Response of Hours to a Technology Shock: a Two-Step Structural VAR Approach", *Journal of Money, Credit and Banking*, 41, 987–1013.
- Bec, F, A. Guay et E. Guerre (2008), "Adaptive Consistent Unit Root Tests Based on Autoregressive Threshold Model," *Journal of Econometrics*, 142, 94-133.
- Dridi R., A. Guay et E. Renault (2007), "Inference Indirect and Calibration of Dynamic Stochastic General Equilibrium Model," *Journal of Econometrics*, 136, 397-430.
- Guay, A, et E. Guerre (2006), "A Data-Driven Nonparametric Specification Test for Dynamic Regression Models," *Econometric Theory*, 22, 543-586.
- Guay A. et Pierre St-Amant (2005), "Do Hodrick-Prescott and Baxter-King Filters Provide a Good Approximation of Business Cycles," *Annales d'Économie et de Statistiques*, 77, 133-156.
- Fauvel, Y., A. Guay et A. Paquet (2005), "Les neuf vies de la courbe de Phillips américaine: réincarnations ou résilience," L'actualité économique., 81, no 4.
- Ghysels E. et A. Guay (2004), "Testing for Structural Change in the Presence of Auxiliary Models," *Econometric Theory*, 20, 1168-1202.
- Guay A. (2003), "Optimal Predictive Tests," Econometric Reviews, 22, 379-410.
- Ghysels, E., et A. Guay (2003), "Structural Change Tests for Simulated Method of Moments", *Journal of Econometrics*, 115, 91-123.
- Guay, A. et O. Scaillet (2003), "Indirect Inference, Nuisance Parameter and Threshold Moving Average Models", *Journal of Business, Economics and Statistics*, 21, 122-132.
- Guay, A., R, Luger et Z. Zhu (2002), "The New Phillips Curve in Canada," dans *Price Adjustment and Monetary Policy*, Bank of Canada.
- Dupasquier, C, A. Guay et P. St-Amant (1999), "A Comparison of Alternative Methodologies for Estimating Potential Output and the Output Gap," *Journal of Macroeconomics*, 21, 577-595.

- Ghysels, E., A. Guay et A. Hall (1997), "Predictive Tests for Structural Change: Analysis with Unknown Breakpoint", *Journal of Econometrics*, 82, 209-233.
- Beaudry, P. et A. Guay (1996), "What Do Interest Rates Reveal about the Functioning of Real Business Cycle Models?", *Journal of Economic Dynamics and Control*, 20, 1661-1682.

Financement de la recherche

- CRSH-Connexion, avec Dalbor Stevanovic pour l'organisation de la conférence annuelle du NBER-NSF Time Series Conference, \$25,000 (2023).
- CRSH-Savoir, individuel, subvention pour quatre ans pour un montant de \$92,416 (2018-2022).
- CRSH-Connexion, avec Dalbor Stevanovic et Benoit Perron, pour l'organisation de la conférence annuelle de l'International Association of Applied Econometrics (IAAE), \$25,000.
- FQRSC équipe avec Hafehd Bouakez (HEC), Michel Normandin (HEC) et Francisco Ruge-Murcia (McGill). Subvention pour quatre ans au montant individuel de \$14,000 par année (2017-2022) pour un montant total de 224,000\$ pour l'équipe pour les quatre années.
- FQRSC équipe avec Hafehd Bouakez (HEC), Michel Normandin (HEC), . Subvention pour quatre ans au montant individuel de \$21,000 par année (2012-2016).
- FQRSC équipe avec Hafehd Bouakez (HEC), Michel Normandin (HEC), Louis Phaneuf (ESG-UQAM) et Frederico Ravenna (HEC). Subvention pour quatre ans au montant individuel de \$21,000 par année (2012-2016).
- ANR (Agence Nationale de la Recherche, France) équipe avec Patrcik Fève (TSE), Frank Portier (TSE) et Martial Dupaigne (TSE et Montpellier). Subvention pour quatre ans au montant total de 150,000 euros (2014-2018).
- FQRSC équipe avec Jean Boivin (HEC), Hafehd Bouakez (HEC), Michel Normandin (HEC) et Louis Phaneuf (ESG-UQAM). Subvention pour quatre ans au montant individuel de \$16,000 par année (2008-2012).
- CRSH individuel, subvention pour trois ans pour un montant annuel de \$ 20,000 (2008-20011).

Direction de thèses et mémoires

J'ai dirigé (ou en cours de direction) :

- 52 mémoires de maîtrise
- 9 thèses de doctorat

Responsabilités administratives

- Cotitulaire de la Chaire en macroéconomie et prévisions de l'ESG-UQAM (2020–2025). Cette Chaire, qui a débuté ses activités au début de 2020, est financée par le ministère des Finances et le ministère du Travail de l'Emploi et de la Solidarité sociale du Gouvernement du Québec, Hydro-Québec, la Caisse de dépôt et placement du Québec à hauteur de 2,600,000\$ pour cinq ans.
- Directeur du Département des sciences économiques (2015–2020), École des sciences de la gestion, UQAM.
- Codirecteur du centre de recherche CIRPÉE et directeur de la composante CIRPÉE-UQAM, 2005 à 2010. Ce centre de recherche interuniversitaire etait financé par le FQRSC en tant que regroupement stratégique.
- Membre du comité de la recherche de l'ESG (2005-2006, 2006-2007, 2007-2008, 2008-2009, 2009-2010).
- Membre du comité des partenaires du Consortium sur l'innovation, les performances et le bien-être dans l'économie du savoir (CIBL'es) (2005-2006, 2006-2007, 2007-2008 et 2008-2009).
- Membre du comité exécutif du département (2003-2004, 2005-2006, 2008-2009, 2009-2010, 2011-2012, 2012-2013, 2015-2016, 2016-2017, 2017-2018, 2018-2019, 2019-2020, 2020-2021, 2021-2022).
- Membre du comité d'examen des candidatures professorales (2003-2004, 2005-2006, 2008-2009, 2011-2012, 2012-2013 et 2013-2014, 2015-2016, 2016-2017, 2017-2018, 2019-2020).
- Membre du comité d'évaluation des professeurs du département. (2004-2005, 2006-2007, 2012-2013 (substitut), 2013-2014 (substitut), 2014-2015, 2015-2016, 2016-2017, 2017-2018).
- Membre du comité des études de cycles supérieurs du département (2003-2004, 2004-2005, 2005-2006, 2006-2007, 2007-2008, 2008-2009 et 2009-2010).
- Membre du comité de recherche et d'orientation du département (2005-2006, 2006-2007, 2007-2008, 2008-2009, 2009-2010, 2015-2016, 2016-2017, 2017-2018, 2018-2019, 2019-2020, 2020-2021, 2021-2022).
- Responsable du placement des étudiants des cycles supérieurs du département (2003-2004, 2004-2005, 2005-2006, 2006-2007, 2007-2008, 2008-2009, 2009-2010 et 2011-2012).

- Représentant du département à la maîtrise en finance appliquée et DESS en finance (2009-2010).
- Conseil d'administration de l'Institut des sciences de l'environnement (2015-2016, 2016-2017, 2017-2018).
- Membre du comité sectoriel institutionnel d'octroi de bourses CRSH pour la maîtrise et le doctorat à l'UQAM (2004).
- Membre du protocole CSN/FTQ/UQAM (2004-2005, 2005-2006, 2006-2007 et 2007-2008).
- Membre du groupe de discussion conjoint CSN/FTQ/UQAM portant sur des questions économiques (2004-2005, 2005-2006 et 2006-2007).
- Membre du conseil syndical (SPUQ) (2007-2008 et 2008-2009, 2009-2010, 2011-2012, 2012-2013, 2013-2014 et 2014-2015)
- Membre du comité de mentorat du département (2013-2014 et 2014-2015, 2020-2021, 2021-2022)

Autres

- Organisateur (avec Dalibor Stevanovic) de la conférence à venir du NBER-NSF Time Series Conference, octobre 2023.
- Organisateur local (avec Dalibor Stevanovic) de la conférence du North American Summer Meeting de l'Econometric Society, 10 au 13 juin 2021.
- Organisateur local (avec Benoit Perron et Dalibor Stevanovic) de la conférence annuelle de l'International Association of Applied Econometrics (IAAE), 26 au 29 juin 2018.
- Président sortant de la Société canadienne de science économique (SCSE, 2016-2017).
- Président de la Société canadienne de science économique (SCSE, 2015-2016).
- Président désigné de la Société canadienne de science économique (SCSE, 2014-2015) et organisateur du congrès annuel, UQAM, 2015.
- Vice-président de la société canadienne de science économique (SCSE) (2004-2005, 2005-2006, 2006-2007, 2007-2008 et 2008-2009).

- Membre du comité d'octroi de subventions FQRSC aux jeunes chercheurs (2004 et 2005).
- Président du comité d'octroi de subventions FQRSC aux jeunes chercheurs (2009, 2010 et 2011).
- Membre du comité d'organisation de la conférence mondiale 2015 de l'Econometric Society.
- Membre du comité d'organisation de la conférence annuelle du Canadian Econometric Study Group en 2006.
- Consultant pour KPMG (2015-2018).
- Consultant pour la Caisse de dépôt et de placement du Québec (2014): projet portant sut la pévision de l'inflation américaine à l'aide de données à différentes fréquenes.

Consultant pour la Banque du Canada dans le cadre de deux projets intitulés:

- Another Look at Housing Wealth Effects in Canada.
- Impact des prix des maisons sur la consommation des biens non durables des ménages.

Consultant pour l'OCDE. Deux documents de travail à paraître:

- HP filtering and SVAR models: An assessment, avec F. Pelgrin, 75 pages.
- SVAR models and the short-run resilience effect, avec F. Pelgrin, 82 pages.

Textes de vulgarisations:

- Quotidiens
 - 1. Pour que le remède n'achève pas le patient, avec Marie Connally, Catherine Haeck, Charles Séguin, Dalibor Stevanovic, Marie-Louise Leroux et Ariana Degan, Le Devoir, décembre 2014.
 - 2. Le buget de l'an 1 de François Legault est un document équilibré et utile, avec Niclas Marceau dans La Presse, 13 mai 2005.
 - 3. Depuis 25 ans, le modèle québécois a permis à notre économie de combler une portion importante de son retard, avec Nicolas Marceau dans La Presse, 13 décembre 2004.
- Monographie et chapitres de livre:

1. Le Québec n'est pas le cancre économique qu'on dit, avec Nicolas Marceau, dans L'annuaire du Québec 2005, Montréal, Éditions Fides, 66–83, 2004.