

BENOIT PERRON

Département de sciences économiques
 Université de Montréal
 C.P. 6128, succursale Centre-ville
 Montréal (Québec) H3C 3J7

Téléphone: (514) 343-6760
 Courriel : Benoit.perron@umontreal.ca

Diplômes

Ph. D., Économie, Yale University, 1998
 M. A., Économie, Queen's University at Kingston, 1993
 B. A., Économie, Concordia University, 1992

Postes académiques

Directeur, Département de sciences économiques, Université de Montréal, 2020-
 Professeur titulaire, Département de sciences économiques, Université de Montréal, 2011-
 Directeur, Centre interuniversitaire de recherche en économie quantitative (CIREQ), 2015-2020
 Professeur agrégé, Département de sciences économiques, Université de Montréal, 2005-2011
 Professeur invité, Graduate School of Business, University of Chicago, 2005.
 Professeur adjoint, Département de sciences économiques, Université de Montréal, 1998-2005
 Chercheur associé, Centre de recherche et développement en économie, Université de Montréal. 1998-
 Chercheur régulier, Centre interuniversitaire de recherche en économie quantitative (CIREQ), 2002-
 Chercheur et Fellow, Centre Interuniversitaire en recherche et analyse des organisations (CIRANO), 2002-

Bourses et subventions

Conseil de recherche en sciences humaines, Subvention Savoir, Factor models for forecasting and macroeconomic applications, 2020-2024, 85 138\$
 Fonds de recherche du Québec - Société et culture, Soutien aux équipes de recherche, *Économétrie financière, rendements des actions et choix de portefeuille*, (Chercheur principal : Marine Carrasco; Co-chercheurs : Prosper Dovonon; René Garcia; Silvia Gonçalves), 2019-2024. 229 000\$
 Conseil de recherche en sciences humaines du Canada, Subvention Savoir, *Bootstrap Inference in Econometric Models with Estimated Factors*, 2016-2020, 56 000\$.
 Fonds Québécois de la Recherche sur la Société et la Culture, Projets franco-québécois FQRSC-ANR, (Coordonnateurs : S. Gonçalves et N. Meddahi, Co-chercheurs : C. Bontemps; P. Dovonon; R. Garcia), *Mélange de fréquences de données pour la valorisation et la gestion de risque des actifs financiers*, 2011-2015, 50 000\$
 Conseil de recherche en sciences humaines du Canada, Subvention ordinaire de recherche, *Factor models in macro panel data*, 2010-2013, 62 500\$.
 Conseil de recherche en sciences humaines du Canada, Subvention ordinaire de recherche, *The risk-return trade-off at different horizons*, 2007-2010, 45 000\$
 Conseil de recherche en sciences humaines du Canada, Subvention ordinaire de recherche, *Long memory in volatility : consequences and inference tools*, 2004-2007, 62 900\$
 Fonds Québécois de la Recherche sur la Société et la Culture, Soutien aux équipes de recherche (Coordonnateur : Éric Renault), *Méthodes d'inférence statistique pour les modèles d'évaluation d'actifs financiers : variables latentes implicites, méthodes simulées et récursives*, 2004-2008.
 Fonds FCAR, Établissement de nouveaux chercheurs, *Problèmes d'identification dans les modèles financiers*, 2001-04
 Fonds FCAR, Soutien aux équipes de recherche (Coordonnateur : Éric Renault), *Tests statistiques des modèles économiques : apport de nouvelles approches partiellement non paramétriques*, 2001-2004.
 Programme de subventions aux professeurs adjoints, Université de Montréal, *Estimation et prévision de la volatilité et modélisation de la prime de risque sur les marchés financiers avec des outils non-paramétriques*, 2000-01.
 Mathématiques des technologies de l'information et des systèmes complexes (MITACS), *Simulation, Estimation and Inference in Financial Models for Risk Management and Derivative Pricing*, (Chercheur principal : Jean-Marie Dufour; co-chercheurs : J Detemple; R Garcia; L Khalaf; N Meddahi; E Renault; M Rindisbacher; R Roy; M Carrasco; S Gonçalves), 1999-2010, 656 000\$.

Publications (la norme en sciences économiques est que les auteurs sont en ordre alphabétique)

Articles dans revues avec comité de lecture

- Conley, Tim, Silvia Gonçalves, Min Seong Kim et Benoit Perron, « Bootstrap inference under cross sectional dependence », *Quantitative Economics*, à paraître.
- Goncalves, Silvia et Benoit Perron, « Bootstrapping Factor Models with Cross-sectional Dependence », *Journal of Econometrics*, 218:2, octobre 2020, 476-495.
- Bandi, Federico, Benoit Perron, Andrea Tamoni et Claudio Tebaldi, « The Scale of Predictability », *Journal of Econometrics*, 208:1, 2019, 120-140.
- Gonçalves, Silvia, Michael W. McCracken et Benoit Perron, « Tests of Equal Accuracy for Nested Models with Estimated Factors », *Journal of Econometrics*, 198:2, 2017, 231-252.
- Gonçalves, Silvia, Benoit Perron et Antoine Djogbenou, « Bootstrap Prediction Intervals for Factor Models », *Journal of Business and Economic Statistics*, 35:1, 2017, 53-69.
- Djogbenou, Antoine Silvia Gonçalves et Benoit Perron, « Bootstrap inference in regressions with estimated factors and serial correlation », *Journal of Time Series Analysis*, 36:3, 2015, 481-502.
- Moon, Hyungsik Roger, Benoit Perron et Peter C.B. Phillips, « Point Optimal Panel Unit Root Tests with Serially Correlated », *Econometrics Journal*, 17, 2014, 338-372.
- Gonçalves, Silvia et Benoit Perron, « Bootstrapping Factor-augmented Regressions », *Journal of Econometrics*, 182, 2014, 156-173.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron, « Peter C.B. Phillips' Contributions to Panel Data Methods », *Econometric Theory*, 30, 2014, 882-893.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron, « Beyond Panel Unit Root Tests: Using Multiple Testing to Determine the Nonstationarity Properties of Individual Series in a Panel », *Journal of Econometrics*, 169, 2012, 29-33.
- Bandi, Federico et Benoit Perron, « Long-run risk-return trade-offs », *Journal of Econometrics*, 143, 2008, 349-374.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron, « Asymptotic Local Power of a Test for Unit Roots in Panels with Fixed Effects », *Econometrics Journal*, 11, 2008, 80-104.
- Moon, Hyungsik Roger, Benoit Perron et Peter C.B. Phillips, « Incidental Trends and the Power of Panel Unit Root Tests », *Journal of Econometrics*, 141, 2007, 416-459.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron, « An Empirical Analysis of Nonstationarity in a Panel of Interest Rates with Factors », *Journal of Applied Econometrics*, 22, 2007, 383-400.
- Moon, Hyungsik Roger, Benoit Perron et Peter C.B. Phillips, « On the Breitung Test for Panel Unit Roots and Local Asymptotic Power », *Econometric Theory Notes and Problems*, 22, 2006, 1179-1190.
- Bandi, Federico et Benoit Perron, « Long Memory and the Relation between Implied and Realized Volatility », *Journal of Financial Econometrics*, 4, automne 2006, 636-670.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron, « Efficient Estimation of the SUR Cointegration Regression Model and Testing for Purchasing Power Parity », *Econometric Reviews*, 23:4, février 2005, 293-323.
- Perron, Benoit, « Détection non paramétrique des sauts de la volatilité », *L'Actualité économique* (numéro en l'honneur de Marcel Dagenais), 80 :2-3, juin-septembre 2004, 229-251.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron, « Testing for a Unit Root in Panels with Dynamic Factors », *Journal of Econometrics*, 122:1, septembre 2004, 81-126.
- Morel, Louis et Benoit Perron, « Relation entre le taux de change et les exportations nettes: test de la condition Marshall-Lerner pour le Canada », *L'Actualité économique*, 79 :4, décembre 2003, 481-502.
- Linton, Oliver et Benoit Perron, « The Shape of the Risk Premium: Evidence from a Semiparametric GARCH Model », *Journal of Business and Economic Statistics*, 21-3, juillet 2003, 354-367.
- Perron, Benoit, « Semi-parametric Weak Instrument Regressions with an Application to the Risk-Return Tradeoff », *Review of Economics and Statistics*, 85:2, mai 2003, 424-443.

Chapitres dans des ouvrages collectifs

- Moon, Hyungsik Roger, Benoit Perron et Peter C.B. Phillips, « Incidental Parameters and Dynamic Panel Modeling » dans Badi H. Baltagi. *Oxford Handbook of Panel Data*, Oxford University Press, 2015, 111-148.
- Moon, Hyungsik Roger et Benoit Perron « Seemingly Unrelated Regressions », *The New Palgrave Dictionary of Economics*, 2nd ed, Eds. Steven N. Durlauf and Lawrence E. Blume. Palgrave Macmillan, 2008.

Autres publications

- Campbell, Bryan, Michel Magnan, Benoit Perron et Molivann Panot « Modélisation de règles budgétaires pour l'après-COVID », Centre interuniversitaire de recherche en analyse des organisations, Rapport de projet 2021RP-31.
- Bandi, Federico, Alex Maynard, Hyungsik Roger Moon et Benoit Perron, «Special Issue "Celebrated Econometricians: Peter Phillips"», *Econometrics* 9(3), 29, 2021.
- Gonçalves, Sílvia et Benoit Perron, «Discussion of .Bootstrap prediction intervals for linear, nonlinear, and nonparametric autoregressions., by Pan Li and Dimitris Politis, *Journal of Statistical Planning and Inference*, 177, 2016, 31-34.
- Campbell, Bryan, Michel Magnan, Benoit Perron et Zabiullah Tarshi, « Règles budgétaires touchant les dépenses consolidées». Centre interuniversitaire de recherche en analyse des organisations, Rapport de projet 2016RP-10.
- Dufour, Jean-Marie et Benoit Perron, Editors' Introduction : Resampling Methods in Econometrics, *Journal of Econometrics*, 133, août 2006, 411-419.
- Perron, Benoit, «Equivariance of an Instrumental Variable Estimator in the Linear Regression Model», *Solution 97.2.5, Econometric Theory*, 14, 1998, p. 292-293.

Travaux non publiés

- Goncalves, Silvia, Julia Koh et Benoit Perron, «Bootstrap Inference for Group Factor Models», avril 2023.
- Bandi, Federico, Abraham Lioui, René Garcia et Benoit Perron, «A Long-Horizon Perspective on the Cross-Section of Expected Returns», août 2013.

Activités éditoriales

- Éditeur invité, numéro spécial du *Journal of Econometrics*, «Identification, Inference, and Causality», 2016-2020
- Éditeur invité, numéro spécial de *Econometrics*, «Celebrated Econometricians: Peter Phillips», 2016-2020
- Comité de rédaction, *Quantitative Finance and Economics*, 2017-
- Comité de rédaction, *Economia*, 2019-
- Comité de rédaction, *Québec économique*, 2016-2017
- Comité de rédaction, *Economics Letters*, 2012-
- Comité de rédaction, *Journal of Business and Economics Statistics*, 2007-2015
- Comité de rédaction, *Empirical Economics*, 2006-2015
- Comité de rédaction, *L'Actualité économique*, 2004-2007
- Comité consultatif *Canadian Journal of Economics*, 2000-2004
- Éditeur invité, numéro spécial du *Journal of Econometrics*, «Resampling Methods in Econometrics», 2006.

Arbitre pour les revues suivantes (en ordre alphabétique):

Actualité économique, Annals of Statistics, ASTA Advances in Statistical Analysis, B.E. Journal of Macroeconomics, Bulletin of Economic Research, Canadian Journal of Development Studies, Canadian Journal of Economics, Communications in Statistics – Theory and Methods, Computational Statistics and Data Analysis, Econometric Reviews, Econometric Theory, Econometrica, Econometrics, Econometrics Journal, Economic Inquiry, Economic Modelling, Emerging Market Finance and Trade, European Journal of Finance, Finance Research Letters, International Review of Economics and Finance, International Review of Finance, International Statistical Review, Journal of Applied Econometrics, Journal of Banking and Finance, Journal of Business and Economics Statistics, Journal of Econometrics, Journal of Economic Dynamics and Control, Journal of Empirical Finance, Journal of Environmental Modeling and Software, Journal of Financial Econometrics, Journal of Human Resources, Journal of International Economics, Journal of Nonparametric Statistics, Journal of Time Series Analysis, Macroeconomic Dynamics, Oxford Bulletin of Economics and Statistics, Physica A, Review of Economic Studies, Review of Economics and Statistics, Review of International Economics, Quantitative Economics, Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics

Organismes subventionnaires:

National Science Foundation, Conseil de recherche en sciences humaines du Canada, Conseil de recherche en sciences naturelles et génie du Canada, Organisation hollandaise pour la recherche scientifique (NWO), Hong Kong Research Grants Council, Israel Science Foundation, National Council for Scientific Research de Roumanie, Fonds de recherche du Québec, MITACS

Étudiants de doctorat encadrés

- Ayivodji, Firmin, « Essais sur les modèles à facteurs dynamiques et la croissance économique », en cours
- Tewou, Kokouvi, « Essays in Financial Econometrics and Asset Pricing » (codirigé avec Ilze Kalnina, soutenue le 27 avril 2020)
- Djogbenou, Antoine, « Essays on inference in Factor-augmented Regressions » (codirigé avec Silvia Gonçalves, thèse soutenue le 29 juillet 2016)
- Belinga, Vincent, « On the Dynamic Effects of Fiscal Policy » ((codirigé avec Emanuela Cardia, thèse soutenue le 8 septembre 2015)
- Some, Dommèbèiwin Juste Mètoiolè, « Essays on Oil Price Fluctuations and Macroeconomic Activity » (codirigé avec Emanuela Cardia, thèse soutenue le 10 octobre 2014)
- Atewamba, Calvin, « Trois essais en économies des ressources naturelles » (codirigé avec Gérard Gaudet, thèse soutenue le 14 mai 2012).
- Houkannounon, Bertrand, « Bootstrap for panel data with application to the evaluation of public policies » (superviseur principal, thèse soutenue le 28 octobre 2011).
- Takeu, Justin Johnson, « Essais en économie de l'environnement et des ressources naturelles sous incertitude » (codirigé avec Gérard Gaudet, thèse soutenue le 23 novembre 2010)

Jurys de thèse de doctorat

- N'Dri, Stéphane, « Three Essays in Asset Pricing and Climate Finance », septembre 2022.
- Idriss Tsafack Teufack, « Essays in Functional Econometrics and Financial Markets », août 2020
- N'Golo Kone, « Optimal Portfolio Selection with Transaction Costs », juillet 2020
- Nayihouba, Ada, « Essays in Dynamic Panel Data Models and Labor Supply », août 2019.
- Pondi Endengle, Eric Marius, « Essays in Empirical Asset Pricing », novembre 2018.
- Adjogou, Folly, « Analyse statistique de données fonctionnelles à structures complexes », septembre 2017.
- Hussain, Jakir, « Three Essays on the Measurement of Productivity », avril 2017.
- Sango, Joël, « Sur les tests de type diagnostic dans la validation des hypothèses de bruit blanc et de non corrélation », septembre 2016.
- Liu, Yu, « Credit Migration of an Internal rating System for a Canadian SME Loans Portfolio », juillet 2015.
- Somé, Modeste Yirbèhogrè, « Essays in Macro Finance and Monetary Economics », Université de Montréal, janvier 2015.
- Tchuate, Guy, « Essais en économétrie et en économie de l'éducation », Université de Montréal, août 2014
- Augustybiak, Maciej, « Estimation du modèle GARCH à changement de régimes et son utilité pour quantifier le risque de modèle dans les applications financières en actuariat », Université de Montréal, décembre 2013.
- Noumon, Nérée, « Choix de portefeuille de grande taille et mesures de risque pour preneurs de décision pessimistes », septembre 2013.
- Hounyo, Ulrich, « Bootstrapping High Frequency Data », août 2013.
- Okou, Cedric, « Long-Run Risk-Return Trade-Offs and Strategic Asset Allocation », novembre 2012.
- Biron, Julie, « L'activisme actionnarial: une perspective canadienne », décembre 2011.
- Assa, Hirbod, « On Some Aspects of Coherent Risk Measures and Their Applications », juillet 2011.
- Stevanovic, Dalibor, « Factor models, VARMA processes and parameter instability with applications in macroeconomics », juin 2011.
- Kotchoni, Rachidi, « Efficient Estimation Using the Characteristic Function: Theory and Applications with High-Frequency Data », mai 2010.
- Doko, Firmin, « Exogeneity, weak identification and instrument selection in econometrics », janvier 2010.
- Ntantamis, Christis, « Identifying hidden boundaries within economic data in the time and space domains », 2008.
- Jouini, Tarek, « Inférence exacte simulée et techniques d'estimation dans les modèles VAR et VARMA avec applications macroéconomiques », mars 2008.
- Tédongap, Roméo, « Three Essays in Empirical Asset Pricing », février 2008.
- Tsafack Kemassong, Georges, « Asymmetric Dependence Modeling and Implications for International Diversification and Risk Management », janvier 2008.
- Dovonon, Prosper, « Common Factors in Stochastic Volatility of Asset Returns and New Developments of the Generalized Method of Moments », octobre 2007
- Coudin, Élise, « Inférence exacte et non paramétrique dans des modèles de régression et des modèles structurels en présence d'hétéroscédasticité de forme arbitraire », juin 2007.
- Pelletier, Denis, « Problems in Time Series and Financial Econometrics: Linear Methods for VARMA Modelling, Multivariate Volatility Analysis, Causality and Value-at-Risk », juin 2004.
- Serguei Zernov, « Three essays in financial econometrics » McGill mars 2004

Taamouti, Mohamed, « Techniques d'inférence exacte dans les modèles structurels avec applications macroéconomiques », novembre 2001
 Norma Kozhaya, « Taxes distortionnaires et dépenses gouvernementales dans les modèles de cycle économique », décembre 1999.

Étudiants de maîtrise encadrés

Corbin-Charland, Joël, « Prévisions non linéaires pour les modèles à facteurs », août 2011.
 Calderon, Oscar, « Étude sur les modèles à facteurs dynamiques et les rendements financiers », avril 2011.
 Robichaud, Martin, « Le biais de la volatilité implicite en tant que prévision de la volatilité réalisée », 2010.
 Charland, Simon, « Utilisation de la prime de risque de la variance pour la prévision des rendements d'une coupe transversale », 2009.
 Huang, Xuemei, "Using the Modified FPE Criteria Forecasting the Realized Variance: a Statistical Analysis", 2009.
 Behzadnejad, Fatemeh, "Measuring and Forecasting the Daily Variance Based on High-Frequency Intraday and Electronic Data", 2008.
 Morris, Deirdre, "What is the Effect of Foreign Direct Investment on the Host Economy? An Analysis For Developed Countries with a Focus on Canada", 2008.
 Tafolong, Ernest, « Volatility premium and excess returns », 2008.
 Garon, Claude, « Arbitrage Risque-rendement du marché financier », 2008
 Zaky Reid, Radwa, « Exchange Rate Pass-Through to Canadian Exports Price : An Industry-Based Approach », 2008.
 Blais, Maxime, « Longue mémoire et dépendance de long terme entre les rendements futurs et les volatilités passées réalisées: est-ce que le MSM est un modèle économique qui justifie ces faits empiriques? », 2007
 Belley-Ferris, Isabelle, « Application d'un modèle à facteurs pour l'étude de l'évolution du différentiel salarial pour les pays de l'OCDE », 2006.
 Lorint, Sanda Petruta, « Quantifying Capital Mobility in OECD and EU Areas », 2006.
 Vazquez, Mario, « Relation entre la volatilité implicite et la volatilité réalisée : Le cas des séries avec la cointégration fractionnaire », 2006.
 Ouégnin, François-Alexis, « Évaluation des performances de couverture d'un GARCH multivarié à corrélations conditionnelles dynamiques de type Engle (2002) », 2005.
 Oginé Noël, Olaf, « Les regroupements de 2002 ont-ils influencé la valeur marchande des propriétés résidentielles à Montréal? », 2005.
 Cohen, Charles-Olivier, « Une analyse empirique du lien entre le secteur de l'énergie et le taux de change réel des provinces canadiennes », 2004.
 Moïse, Marie Stéphanie, « Les composantes idiosyncrasiques des prix relatifs canadiens sont-elles stationnaires? », 2003
 Doupamby, Tity, « Impact de la libéralisation de 1992 sur les marchés financiers: cas du KOSPI en Corée », 2003.
 Darveau, Martin, « Qu'en est-il de l'Équivalence Ricardienne dans un modèle de taux de change? », 2003.
 Chamakhi, Slim, « Réseaux de neurones et prévisions des taux de change quotidiens », 2002.
 Tarnowski, Piotr, « Prévision de la volatilité de l'indice S&P 500 à l'aide des options », 2001.
 Joseph, Astrid, « Changements structurels dans les indices boursiers nord-américains », 2001.
 Boulanger, Pascal, « Analyse des taux d'intérêt européens dans le cadre de l'Union économique et monétaire », 2000.

Séminaires et communications (n'inclut pas les communications données par co-auteurs)

Bootstrap inference under cross sectional dependence

Mai 2019	Conférence CIREQ en économétrie: Avancées récentes dans les méthodes de bootstrap
Mai 2019	Société canadienne de science économique, Québec
Avril 2019	Queen's University

"Bootstrapping factor models with cross sectional dependence"

Mai 2018	University of Connecticut
Novembre 2016	Georgetown University
Novembre 2016	University of Maryland
Octobre 2016	Canadian Econometric Study Group
Juin 2016	Canadian Economics Association, Ottawa
Mai 2016	Colloque CIREQ en économétrie en l'honneur de Jean-Marie Dufour
Avril 2016	New York Camp Econometrics XI, Clayton, NY

“Tests of Equal Accuracy for Nested Models with Estimated Factors”

Août 2015 Frontiers of Theoretical Econometrics in celebration of Don Andrews, Constance, Allemagne

“Point Optimal Panel Unit Root Tests with Serially Correlated Errors”

April 2013 New York Camp Econometrics VIII, Bolton Landing, NY

“The Scale of Predictability”

Octobre 2014 Duke University

Juin 2014 Measuring and Modeling Financial Risk Using High Frequency Data, Florence, Italie

Mai 2014 Toulouse Financial Econometrics conference

“Bootstrap Prediction Intervals for Factor Models”

Octobre 2014 Canadian Econometrics Study Group, Vancouver

Février 2014 Université de Sherbrooke

Juin 2013 Canadian Economics Association, Montréal

Avril 2013 Queen's University at Kingston

Décembre 2012 23^e conférence (EC)², Maastricht

Octobre 2012 University of Southern California

Octobre 2012 University of California, San Diego

Bootstrapping Factor-augmented Regressions”

Janvier 2013 Econometric Society North American Winter Meeting, San Diego

Octobre 2011 Cornell University

 Canadian Econometric Study group, Toronto

Juillet 2011 Conférence en honneur de Hashem Pesaran, Cambridge. UK

 17^e conférence internationale sur les données de panels, Montréal

Mai 2011 CIREQ time series conference, Montréal

Mars 2011 Syracuse University

Janvier 2011 Institut d'économie appliquée, HEC Montréal

“A Long-Horizon Perspective on the Cross-Section of Expected Returns”

Juin 2011 Society for Financial Econometrics, Chicago

“Conditional Information and the Cross-section of Expected Returns in the Long Run”

Février 2011 Atelier CIRPÉE sur les séries chronologiques financières appliquées

Août 2010 congrès mondial de l'Econometric Society, Shanghai

Mai 2010 Canadian Economics Association, Québec

Mars 2009 Rice University

Mars 2009 Texas A&M University

Novembre 2008 HEC Montréal

Juin 2008 Society for Financial Econometrics, New York

Mai 2008 Financial Econometrics Conference, Imperial College, London

“ Beyond Panel Unit Root Tests: Using Multiple Testing to Determine the Non Stationarity Properties of Individual Series in a Panel”

Mars 2010 Conférence Resampling and High-Dimensional Data, Texas A&M Univ., College Station, TX

Octobre 2009 Colloque CIREQ-CIRANO sur l'économétrie des interactions

Juillet 2008 Conférence en l'honneur du 60^e anniversaire de Peter Phillips, Singapore Management University

“Long-Run Risk-Return Trade-offs”

Mars 2007 New York Econometrics Camp II Saratoga Springs, New York

Décembre 2006 Conférence CIREQ sur les séries temporelles

“Incidental Trends and the Power of Panel Unit Root Tests”

Mars 2007	Boston University
Février 2006	New York Econometrics Camp I, Saratoga Springs, New York
Août 2005	Congrès mondial de l'Econometric Society, Londres

«An Empirical Analysis of Nonstationarity in Panels of Exchange Rates and Interest Rates with Factors»

Mars 2006	University of Toronto
Novembre 2005	Graduate School of Business, University of Chicago
	Cornell University
Mars 2005	Queen's University at Kingston

«Panel Evidence on Unit Roots in Exchange Rates and Interest Rates with Cross-sectional Dependence»

Mars 2005	Queen's University at Kingston
Septembre 2004	Canadian Econometric Study Group, Toronto
Juin 2004	11 th International Conference on Panel Data, College Station, Texas
Décembre 2003	University of Rochester
Septembre 2003	Texas A&M
	Rice University
Mai 2003	Conférence CIREQ-CIRANO-MITACS en économétrie de la finance, Montréal
	Congrès de la Société canadienne de science économique, Montréal

«Long Memory and the Relation Between Implied and Realized Volatility»

Juin 2004	5e conférence annuelle de MITACS, Halifax
Mars 2004	University of Southern California
Janvier 2002	North American Winter Meeting, Econometric Society, Atlanta
Septembre 2001	Canadian Econometric Study Group, Waterloo
Mai 2001	Congrès de la Société canadienne de science économique, Québec
Avril 2001	Atelier CRDE: Modélisation, estimation et prévision de la volatilité, Montréal.

« The Seemingly Unrelated Dynamic Cointegration Regression Model and Testing for Purchasing Power Parity»

Juin 2001	Congrès de l'Association canadienne d'économie, Montréal
Mai 2000	Congrès de la Société canadienne de science économique, Montréal
Mars 2000	Atelier d'économétrie de Montréal

«The Shape of the Risk Premium: Evidence from a Semiparametric GARCH Model»

Juillet 2002	Current Advances And Trends In Nonparametric Statistics, Crete, Greece
Octobre 2000	Graduate School of Business, University of Chicago
Mars 2000	University of Waterloo, Financial Econometrics conference
	University of California, Santa Barbara
Décembre 1999	European Conference of the Econometrics Community, Madrid
Novembre 1999	Queen's University at Kingston
Septembre 1999	Centre de recherche et développement en économie

«Jumps in the Volatility of Financial Markets»

Septembre 1998	Canadian Econometric Study Group, London
Novembre 1996	Yale University

«Semi-parametric Weak Instrument Regressions with an Application to the Risk-Return Tradeoff»

Août 2000	Congrès mondial de l'Econometric Society, Seattle
Mai 1999	Congrès de la Société canadienne de science économique
Avril 1999	University of Windsor

Février 1998	Université de Montréal Concordia University Rutgers University
Janvier 1998	University of Toronto Florida International University

Responsabilités administratives

Président, comité de recrutement, Département de sciences économiques, Université de Montréal, 2014-2017
Responsable des programmes de premier cycle, Département de sciences économiques, Université de Montréal, 2007-2011
Membre comité des études de premier cycle, Faculté des arts et des sciences, Université de Montréal, 2007-2010.
Responsable, programmes bidisciplinaires mathématique-économie et économie-informatique, 1999-2005

Organisation d'évènements

Co-organisateur, Congrès annuel de l'*International Association for Applied Econometrics*, 26-29 juin 2018.
Co-organisateur, «Colloque CIREQ en économétrie : Séries temporelles et économétrie de la finance», 2013-2015.
Co-organisateur, Conférence «Econometrics of Interactions», octobre 2009
Co-organisateur, Conférence C.R.D.E. «Resampling Methods in Econometrics / Méthodes de rééchantillonnage en économétrie», octobre 2001

Autres responsabilités

Membre, Comité scientifique, Centre interuniversitaire de recherche en analyse des organisations (CIRANO), 2019-
Comité de programme, North American Summer Meeting of the Econometric Society, juin 2021
Membre comité d'évaluation, Subventions Développement Savoir, Conseil de recherche en sciences humaines, 2016-2018.
Membre comité d'évaluation, Programmes de subvention aux jeunes chercheurs, Fonds québécois de la recherche sur la société et la culture, 2008-2010.
Évaluateur, Programmes de baccalauréat en économie et en économie-mathématique, Université Laval, 2009.
Comité de programme, Atelier canadien d'économétrie, 1999, 2008, 2009, 2010, 2016, 2019.
Comité de programme, Society for Financial Econometrics, 2015, 2020-2023.
Comité scientifique, Congrès de la Société canadienne de science économique, 2007, 2010, 2011.
Membre comité scientifique, Institut de finance mathématique de Montréal, 2006-2012
Membre comité d'évaluation, Programmes de bourses de maîtrise et de doctorat, Fonds québécois de la recherche sur la société et la culture, 2004-2006
Conseil d'administration, Société canadienne de science économique, 2003-2009

Contrats complétés

Ministère de l'Agriculture, des Pêcheries et de l'Alimentation du Québec (2022), Ville de Montréal (2019), Power Financial Corporation (2016), Ministère des finances du Québec (2016, 2021), Société canadienne d'hypothèque et logement (2008-2010), Banque du Canada (2003), Institut des fonds d'investissements du Canada (2021).