

## 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 # 8364  
(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:

**2004 :** Professeur titulaire,  
Université du Québec à Montréal

**1999-2004:** Professeur agrégé,  
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:**

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).

Chercheur invité: GREMAQ, Université de Toulouse, (janvier à juillet 2003, octobre 2004, octobre 2005, octobre 2007, mai 2008, mai 2009 et mai 2012).

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).

Professeur invité: Université des Antilles et de la Guyane, (mars 2004, mars 2005, février 2006, décembre 2006, janvier 2007, novembre 2007, janvier 2008, janvier 2009, janvier 2010, janvier 2011 et décembre 2011).

### **Publications:**

Ambler, S., A. Guay et L. Phaneuf, (2011), "Endogenous Business-Cycle Propagation and the Persistence Problem: The Importance of Labor-Market Frictions." à paraître dans, *Journal of Economic Dynamics and Control*.

Guay, A. et J.F. Lamarche (2011), "Structural Change Tests Based on Implied Probabilities for GEL Criteria", à paraître dans *Econometric Theory*.

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.

**Articles ayant fait l’objet d’une première évaluation:  
révision demandée:**

- Guay, A. et J.F. Lamarche, “Structural Change Tests for GEL Criteria”, resoumis, *Journal of Econometrics*.
- Guay, A., E. Guerre et S. Lazarova, “Robust Adaptive Rate-Optimal Testing for the White Noise Hypothesis”, resoumis *Journal of Econometrics*.
- Guay, A. et F. Pelgrin, “Using implied probabilities to improve estimation with unconditional moment restrictions for weakly dependent data”, *Econometric Reviews*.

**Responsabilités administratives**

- Codirecteur du centre de recherche CIRPÉE et directeur de la composante CIRPÉE-UQAM, 2005 à 2010. Ce centre de recherche interuniversitaire est 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).

Membre du comité de recrutement de professeurs (2003-2004, 2005-2006, 2008-2009 et 2011-2012).

Membre du comité d'évaluation des professeurs du département. (2004-2005 et 2006-2007).

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).

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).

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 et 2011-2012)

### **Autres**

Chercheur invité: CREI, Universitat de Pompeu Fabra de , (septembre 2010 à mai 2011)

Professeur invité: Paris-I, Panthéon-Sorbonnes (mai 2006).

Chercheur invité: GREMAQ, Université de Toulouse, (janvier à juillet 2003, octobre 2004, octobre 2005, octobre 2007 et mai 2008).

Professeur invité: HEC Lausanne (mars 2006 et mai 2008).

Professeur invité: Université des Antilles et de la Guyane, (mars 2004, mars 2005, février 2006, décembre 2006, janvier 2007, novembre 2007 et janvier 2008).

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).

Membre du comité d'organisation de la conférence annuelle du Canadian Econometric Study Group en 2006.

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. *Le budget de l'an 1 de François Legault est un document équilibré et utile*, avec Niclas Marceau dans La Presse, 13 mai 2005.
  2. *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.