

MARINE CARRASCO

CURRICULUM VITAE

Octobre 2021

Adresse Professionnelle

Université de Montréal
Département de Sciences Economiques
CP 6128, succ Centre Ville
Montréal, QC H3C3J7

Téléphone: (514) 343-2394

Email: marine.carrasco@umontreal.ca

Personnel : mariée, trois enfants.

Citoyenneté : canadienne et française.

Education

University of Chicago, Post-doctorat, supervisé par Lars Peter Hansen, 1995-96.

Université Toulouse I, Doctorat en Mathématiques Appliquées, 1992-95.

Université Toulouse I, DEA en Economie Mathématique et Econométrie, 1992.

Université Toulouse III, DEA en Mathématiques Appliquées, 1992.

Universités Toulouse I et III, Magistère d'Economiste Statisticien, 1990-1992.

Thèse

Doctorat en Mathématiques Appliquées sous la direction de Jean-Pierre Florens sur le thème "Econométrie des Modèles dynamiques avec Ruptures", obtenu le 19 décembre 1995 à l'Université Toulouse I, mention très honorable avec félicitations du jury.

Postes et affiliations

Professeure Titulaire, Université de Montréal, juin 2012-présent.

Professeure Agrégée, Université de Montréal, décembre 2005-mai 2012.

Visiting faculty, University of North Carolina at Chapel Hill, août 2010-juin 2011.

Chercheur membre du CIREQ, décembre 2005-présent.

Fellow du CIRANO, février 2006-présent.

Chercheur associé à l'Infometrics Institute (American University, Washington DC), juin 2011-présent.

Assistant Professor, University of Rochester (USA), décembre 2000-novembre 2005.

Chargée de Mission à l'INSEE (France), septembre 1998- octobre 2000.

Assistant Professor, Ohio State University (USA), octobre 1996-juillet 1998.

Moniteur de Travaux Dirigés, Université Toulouse I, octobre 1992-septembre 1995.

Enseignements

Cours d'économétrie des séries temporelles, niveau doctorat.

Cours de statistique et d'économétrie, niveau doctorat.

Cours d'économétrie et de statistique, niveau bac.
Cours de mégadonnées, niveau maîtrise.

Bourses et prix

Président désigné de la Société canadienne de science économique, 2021-2022.

Prix Marcel Dagenais (2018, ex-aequo avec P-C. Michaud)

Prix Multa Scripsit du journal *Econometric Theory* (2017)

CRSH Subvention Savoir (\$154,620), Avril 2020-Mars 2025, "Estimation and inference in nonstandard settings", principal investigateur.

FQRSC, subvention (\$229,000), Avril 2019-Mars 2023, "Économétrie financière, rendements des actions et choix de portefeuille", principal investigateur.

CRSH subvention de développement savoir (\$34,000), Juin 2019-Mai 2021, "Using partial least squares to obtain better instrumental variables estimators", co-applicant.

CRSNG subvention à la découverte (\$85,000), Avril 2015-Mars 2020, "Functional linear regression", principal investigateur.

CRSH Subvention Savoir (\$146,140), Avril 2014-Mars 2019, "Inference and estimation with many moment conditions", chercheur principal.

CRSH Subvention de recherche (\$56,500), Avril 2010-Mars 2013, "Regularization Techniques in Econometrics", chercheur principal.

CRSH Aid to research workshop and conferences in Canada (\$10,000), "Generalized Method of Moments conference", Montreal, Novembre 16-17, 2007.

MITACS team grant (\$14,000/year), Avril 2007-Mars 2011, "Mathematical and Statistical Methods for Financial Modelling and Risk Management".

CRSH Subvention de recherche (\$45,000), Avril 2007-Mars 2010, "Method of moments with many moment conditions", chercheur principal.

Bourse de la National Science Foundation (\$139,562), septembre 2002-décembre 2005.

Seed Grant, Ohio State University, 1997-1998.

Bourse Lavoisier et Fullbright Scholarship, University of Chicago, 1995-96.

Bourse de thèse, Université Toulouse I, 1992-95.

Activités éditoriales

Rédacteur associé de *Journal of Financial Econometrics*, 2007 – 2019.

Rédacteur associé de *Econometric Theory*, juin 2011 – présent

Rédacteur associé de *Econometrics Journal*, janvier 2021 – présent

Rédacteur associé de *Journal of Business & Economic Statistics*, janvier 2022 –.

Corédacteur invité du numéro spécial de *Journal of Econometrics* "Thirtieth Anniversary of Generalized Method of Moments", publié en octobre 2012.

Corédacteur invité du numéro spécial de *Journal of Econometrics* "High Dimensional Problems in Econometrics", publié juin 2015.

Corédacteur invité du numéro spécial en l'honneur de Jean-Marie Dufour de *Journal of Econometrics*, publié octobre 2020.

Arbitre pour *American Economic Review*, *Annales d'Economie et de Statistiques*, *The B.E. Journals in Macroeconomics*, *Canadian Journal of Economics*, *Computational Statistics & Data Analysis*, *Econometrica*, *Econometrics Journal*, *Econometric Theory*, *Econometric Reviews*, *Empirical Economics*, *Journal of Applied Econometrics*, *Journal of the American Statistical Association*, *Journal of Business & Economic Statistics*,

Journal of Econometrics, Journal of Financial Econometrics, Journal of Multivariate Analysis, Louvain Economic Review, Review of Economics and Statistics, Review of Economic Studies, Statistica Sinica, Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics.

Evaluations de demandes de financement pour le CRSH, la *National Science Foundation*, *Fonds pour la Formation de chercheurs et l'Aide à la Recherche* et MITACS.

Membre du comité d'évaluation des demandes de subventions du CRSH en 2009 et 2011.

Membre du comité d'évaluation des bourses Marcel Faribault (UdeM) de 2014 à 2017.

Organisation de conférences et séminaires

Membre du comité du programme de European Econometric Society Meeting, Vienne, 2006.

Membre du comité du programme de la conférence SOFIE, Oxford, 2012, Singapore, 2013, Toronto, 2014, Aarhus, 2015, Hong-Kong June 2016, New York June 2017, Lugano 2018, Shanghai 2019, San Diego 2021.

Membre du comité du programme de l'Association canadienne de science économique, Québec 2019.

Membre du comité du programme de Canadian Econometric Study Group, Montréal 2019.

Membre du comité scientifique de la conférence de l'International Association for Applied Econometrics, Montréal 2020.

Co-organisatrice du Séminaire d'Économétrie de Montréal (2007-2010, 2011-2017, 2018 à présent)

Organisation de la conférence CIREQ de Séries Temporelles, en collaboration avec Nour Meddahi, Montréal, 8-9 décembre, 2006.

Organisation de la conférence CIREQ sur la Méthode des Moments Généralisés, Montréal, 16-17 novembre, 2007.

Organisation de la 3^{ème} conférence CIREQ de Séries Temporelles, en collaboration avec Silvia Goncalves, Montréal, 22-23 mai, 2009.

Organisation de la 4^{ème} conférence CIREQ de Séries Temporelles, en collaboration avec Silvia Goncalves, Montréal, 14-15 mai, 2010.

Organisation de la 5^{ème} conférence CIREQ de Séries Temporelles, en collaboration avec Silvia Goncalves, Montréal, 27-28 mai, 2011.

Organisation de la conférence CIREQ "High Dimensional Problems in Econometrics", en collaboration avec Silvia Goncalves, Montreal, May 4-5, 2012.

World Congress of the Econometric Society, Montréal, 17-21 août, 2015, membre du comité organisateur local.

Organisation de la conférence CIREQ en l'honneur de Jean-Marie Dufour, en collaboration avec Victoria Zinde-Walsh, Montréal, 7-8 mai, 2016.

Organisation de la conférence CIREQ « Inference in Large Econometric Models », en collaboration avec Prosper Dovonon, Montréal, 5-6 mai, 2017.

Organisation de la conférence CIREQ « Recent Advances in the Method of Moments » , en collaboration avec Prosper Dovonon, Montréal, 27-28 avril, 2018.

Articles publiés ou acceptés pour publication

“Testing overidentifying restrictions with many instruments and heteroskedasticity using regularized Jackknife IV” (avec Mohamed Doukali) à paraître dans *The Econometrics Journal*.

“Testing distributional assumptions using a continuum of moments” (avec Dante Amengual and Enrique Sentana), *Journal of Econometrics*, 2020, 218, 655-689.

“Editor’s introduction: Special Issue in Honor of Jean-Marie Dufour on Identification, Inference, and Causality” (avec Marcelo Moreira, Benoit Perron, Victoria Zinde-Walsh), *Journal of Econometrics*, 2020, 218, 243-246.

“The continuum-GMM Estimation: Theory and Application” (avec Rachidi Kotchoni), dans *International Financial Markets*, Vol 1. Editeurs: Julien Chevallier, Stéphane Goutte, David Guerreiro, Sophie Saglio, Bilel Sanhaji, Routledge, 2019, 160-199.

"Efficient estimation using regularized Jackknife IV estimator" (avec Mohamed Doukali), *Annals of Economics and Statistics*, 2017, N.128, 109-149.

“Functional linear regression with functional response” (avec David Benatia et Jean-Pierre Florens), *Journal of Econometrics*, 2017, 201, 269-291.

“Efficient Estimation Using the Characteristic Function” (avec Rachidi Kotchoni), *Econometric Theory*, 2017, Vol 33, 2, 479-526.

“In-sample Inference and Forecasting in Misspecified Factor Models”, avec Barbara Rossi, *Journal of Business & Economic Statistics*, 2016, Vol. 34, N.3, 313-338 (avec commentaires et réponses).

“Efficient estimation with many weak instruments using regularization techniques” (avec Guy Tchuente), *Econometric Reviews*, 2016, 35, 1609-1637.

“Regularized LIML for many instruments” (avec Guy Tchuente), *Journal of Econometrics*, 2015, 186, 427-442.

“Editorial: High dimensional problems in econometrics” (avec Silvia Goncalves, Victor Chernozhukov et Eric Renault), *Journal of Econometrics*, 2015, 186, 277-279.

“Adaptive Realized Kernels” (avec Rachidi Kotchoni), *Journal of Financial Econometrics*, 2015, Vol. 13, N.4, 757-797.

“Asymptotic Normal Inference in Linear Inverse Problems”, avec Jean-Pierre Florens et Eric Renault, dans *Handbook of Applied Nonparametric and Semiparametric Econometrics and Statistics*, Oxford University Press, 2014, p.65-96.

“On the asymptotic efficiency of GMM” (avec Jean-Pierre Florens), *Econometric Theory*, 2014, Vol 30, Issue 2, 372-406.

“Optimal Test for Markov Switching” (avec L. Hu et W. Ploberger), *Econometrica*, 2014, Vol 82, N.2, 765-784.

“A regularization approach to the many instruments problem”, *Journal of Econometrics*, 2012, 170, 383-398.

“Editors’ introduction: Thirtieth Anniversary of GMM” (avec Mehmet Caner, Yuichi Kitamura, et Eric Renault), *Journal of Econometrics*, 2012, 170, 251-255.

“A spectral method for deconvolving a density” (avec Jean-Pierre Florens), *Econometric Theory*, 2011, Vol. 27, issue 03, p. 546-581.

“Nonlinearity and Temporal Dependence” (avec Xiaohong Chen et Lars Peter Hansen), *Journal of Econometrics*, 2010, Vol 155, 2, 155-169.

“Detecting Mean Reversion in Real Exchange Rates: Evidence from a Multiple Regime STAR Specification” (avec Frédérique Bec et Mélika Ben Salem), *Annales d’Economie et de Statistique*, 2010, Number 99/100, 395-427.

“Linear Inverse Problems in Structural Econometrics” (avec Jean-Pierre Florens et Eric Renault), 2007, dans le *Handbook of Econometrics*, Vol. 6, édité par J.J. Heckman et E.E. Leamer, Chapitre 77, Elsevier.

“Efficient estimation of jump diffusions and general dynamic models with a continuum of moment conditions” (avec M. Chernov, J. P. Florens et E. Ghysels), 2007, *Journal of Econometrics*, 140, 529-573.

“Redundancy of Lagged Regressors in a Conditionally Heteroskedastic Time Series Regression”, 2004, *Econometric Theory*, Problems and Solutions section, Vol 20, 228-229.

“Tests for unit-root versus Threshold specification with an application to the PPP” (avec Frédérique Bec et Mélika Ben Salem), 2004, *Journal of Business & Economic Statistics*, Vol. 22, No. 4, 382-395.

“Misspecified Structural Change, Threshold, and Markov-Switching Models”, 2002, *Journal of Econometrics*, Vol. 109, No. 2, 239-273.

“Simulation Based Method of Moments and Efficiency” (avec Jean-Pierre Florens), 2002, *Journal of Business & Economic Statistics*, Vol. 20, No. 4, 482-492.

“Policy Evaluation in Macroeconometric Doubly Stochastic Models” (avec Stéphane Grégoir), 2002, *Annales d’Economie et de Statistiques*, 67-68, 73-109.

“Mixing and Moment Properties of Various GARCH and Stochastic Volatility Models” (avec Xiaohong Chen), 2002, *Econometric Theory*, Vol. 18, No. 1, 17-39.

“Generalization of GMM to a Continuum of Moment Conditions” (avec Jean-Pierre Florens), 2000, *Econometric Theory*, 16, 797-834.

“ β -mixing and Moment Properties of RCA models with application to GARCH(p,q)” (avec Xiaohong Chen), 2000, *Comptes Rendus de l'Académie des Sciences*, t.331, Serie I, 85-90.

Articles soumis

“A regularization approach to the dynamic panel data model estimation” (avec Ada Nayihouba) en révision pour *Econometric Theory*.

“Test for Trading Costs Effect in a Portfolio Selection Problem with Recursive Utility” (avec N’Golo Kone) révisé et resoumis à *Journal of Financial Econometrics*.

“Risk Neutral Density Estimation with a Functional Linear Model” (avec Idriss Tsafack) en révision pour *Advances in Econometrics*.

Autres publications

Traduction (en collaboration avec Josef Perktold) du livre “Econometric Modeling and Inference” de J.-P. Florens, V. Marimoutou et A. Peguin-Feissolle, publiée par *Cambridge University Press*, juin 2007.

Contribution à International Encyclopedia of the Social Sciences, 2^{ème} édition, publiée par Thomson Gale. Article intitulé “Method of Moments”. 2007

Direction de thèse de doctorat

Co-direction de Liang Hu (PhD obtenu en 2006, University of Rochester) “Essays on Optimal Tests”. Assistant professor, Wayne State University (USA).

Directeur de Rachidi Kotchoni (PhD obtenu en 2010, Université de Montréal) “Efficient estimation using the characteristic function”. Professeur adjoint à l’African School of Economics.

Co-direction de Neree Noumon “Optimal portfolio selection” (PhD obtenu en 2013, Université de Montréal). Économiste au FMI.

Co-direction de Guy Tchuente (PhD obtenu en 2014, Université de Montréal) “A Regularization Approach to the Many Weak Instrument Problem: 2SLS, LIML”. Professeur adjoint à Kent University (UK).

Directeur de Mohamed Doukali (PhD obtenu en 2016, Université de Montréal) “Regularized Jackknife estimation with many moment instruments”.

Co-advisor of David Benatia (PhD obtenu en 2018, Université de Montréal) “Analysis of energy market”.

Directeur de Ada Nayihouba (PhD obtenu en 2019, Université de Montréal) “Estimation of dynamic linear models”.

Directeur de Ngolo Kone (PhD obtenu en 2020, Université de Montréal) “Optimal portfolio selection with transaction costs”.

Directeur de Idriss Tsafack Teufack (PhD obtenu en 2020, Université de Montréal) “Forecasting using the functional partial least squares”.

Directeur de Cheikh Nokho (doctorat en cours, Université de Montréal) “Misspecified financial models in a data rich environment”.

Directeur d’Eugène Dettaa (doctorat en cours, Université de Montréal) «Many moment conditions with heteroskedasticity and possible time-dependence”.

Examinateur externe de Pierre Chaussé, UQAM (2011).

Examinateur externe de Danqiao Guo, University of Waterloo (2019).

Examinateur externe de Renfang Tian, University of Waterloo (2020).

Examinateur externe de Christophe Gaillac, Toulouse School of Economics (2021).

Examinateur externe de Christopher Dobronyi, University of Toronto (2021).

Examinateur externe de l’habilitation de Stanislav Anatolyev, Karlova University (2021).

Direction de rapports de maîtrise

Lonege Ogisma (fini en 2007) “Monetary policy, political crisis and inflation in Haiti”.

Su Tan (fini en 2007) “Investigating the law of one price by using a threshold model”.

Damien Chambre (fini en 2008) “Loss functions and option pricing models”.

Bassem Elzeenni (fini en 2010) “Exchange rate prediction using the Taylor rule”.

Aurélié Gilles (fini en 2010) “Out-of-sample prediction of exchange rate using Taylor rule : Evidence from the GBP/USD pair”.

Mara Gloria (fini en 2010) “Exchange Rate predictability: Taylor Rule Fundamentals and Commodity Prices”.

Aoufi Houria (fini en 2010) “Essay on modeling exchange rate incorporating Taylor rule”

Maxime Luciéné (fini en 2010) “Forecast of Canadian exchange rate using models incorporating Taylor rule ”.

Eric Pouémé (fini en 2010) “Taylor rule and exchange rate : Out-of-sample long-term and short-term prediction ”.

Yvonne Niyomwungeri (fini en 2012) “Prévision du taux de change canadien à partir de la règle de Taylor et du prix du pétrole”.

Nicolas Gagnon (fini en 2012) “Modélisation et prévision du taux de change réel canadien”.

Jean Hans Garçon (fini en 2012) “Modélisation et prévision du taux de change canadien à l’aide du modèle ESTAR”.

Sergiu Luca (fini en 2013) “Le modèle SETAR et le taux de change”.

Karim Nchare Fogam (août 2015) “Analyse comparative de la pauvreté et de la structure de consommation des ménages dans la principale agglomération des États membres de l’UEMOA en 2008”, co-supervision, mémoire de maîtrise.

Désiré Kédagni (août 2015) “Identification des mesures d’inégalité dans les modèles de sélection”, co-supervision, mémoire de maîtrise.

Services rendus à l’université

Membre du CONODIR, département d’informatique et de recherche opérationnelle, novembre 2020-mars 2021.

Membre du CONODIR, département de sciences économiques, novembre 2018-mars 2019.

Membre du CONODIR, département de mathématiques et statistique, novembre 2016-février 2017.

Membre du CONOM de juillet 2011 à juin 2014.

Directrice du programme doctoral et placement. juillet 2013-juin 2016.

Directrice de la maîtrise, septembre 2019-juin 2021.

Membre du comité des études de la maîtrise en finance mathématique et computationnelle, juin 2019- présent.

Séminaires invités à des Universités

Aarhus University (Danemark), 2000. University of Austin, 2004. University of British Columbia, 2006. Boston University, 2008, 2018. Bank of Italy, 2000. Brown University, 2012. University of California, Los Angeles, 1998, 2003, 2008. University of California, Riverside, 2015. University of California, San Diego, 2008. University of California, Santa Barbara, 1998, 2015. California Institute of Technology, 2009. Cambridge University, 2017. University Carlos III, 2010. University of Chicago, 1996, 2006. University College London, 1999. Columbia University, 2004. Copenhagen University (Denmark), 2000. CORE (Louvain-La-Neuve, Belgique), 1994, 2000, and 2010. Cornell University, 1998. CREST (INSEE, Paris), 1994, 1999, and 2005. Duke University, The Fuqua, 2011. ENSAI, Rennes (France), 1999. Federal Reserve Bank of Atlanta, 2005. Georgetown University, 2011. Harvard-MIT, 2008. HEC Geneve, 2007. Indiana University, 2009. Institut for Advanced Studies, Vienna (Autriche), 1999. Institut Henri Poincaré, Paris, 2005. ITAM, Mexico, 2002. Université de Laval (Canada) 1998. Université Lille III (France), 1999. London School of Economics, 1999. University of Michigan, 2002. Michigan State University, 2002. Université de Montréal, 1995, 1998, 2000, 2001, 2004. University of North Carolina at Chapel Hill (joint avec NC State et Duke), 2004, 2007. UNC Chapel Hill, 2011. Ohio State University, 1996, 2003. Pennsylvania State University, 1998 and 2000. Pittsburgh University, 1996, 2000, and 2004. Princeton University, (1998, 2005). Queen's University, 2001 and 2014. Rice University, 2003 and 2013. University of Rochester, 2000, 2012. University of Southern California, 1998. Texas A&M, 2003 and 2013. Simon Fraser University, 2006, 2021. Stanford University, 1996. Technische Universität, Vienne (Autriche), 1999. University of Toronto, 2001. École d'économie de Toulouse (France), 1999, 2003, 2005, 2021. University of Venice (Italie), 2000. University of Waterloo, 2019. York University (UK), 2000.

Conférences

“Misspecified Structural Change, Threshold and Markov-Switching Models”, présenté à la First ENTER Jamboree (Mannheim, Allemagne, Mai 1994); Econometric Society European Meeting, (Maastricht, Hollande, août 1994); ASSET Meeting (Southern European Association for Economic Theory), Lisbonne, Portugal, Novembre 1994; Journées de Statistique, Paris, Mai 1995; Midwest Econometrics Group, East Lansing, Octobre 1997.

“Generalization of GMM to a Continuum of Moment Conditions” avec Jean-Pierre Florens, présenté à Jeunes Economètres, Lille, France, May 1995, North American

Meeting of the Econometric Society, San Francisco, janvier 1996, Econometric Society European Meeting, Toulouse, France, août 1997.

“Kernel Estimation of the Density of a Change-Point in the Mean”, présenté à the North American Meeting of the Econometric Society (New Orleans, janvier 1997) ; Third International Conference, Computing in Economics and Finance (Stanford, juin 1997).

“Chi Square Tests when a Nuisance Parameter is Present Only Under the Alternative”, présenté à the North American Meeting of the Econometric Society (Chicago, janvier 1998); Winter Meeting of the European Econometric Society (Rotterdam, Hollande, janvier 1999); Econometric Society European Meeting (Santiago de Compostela, Espagne, août 1999).

“Time Deformation and Dependence” with Xiaohong Chen and Lars Hansen, présenté à the Sixth Workshop of Financial Modeling and Econometric Analysis (Lille, France, janvier 1999); Journées de Statistique (Grenoble, France, mai 1999).

“Mixing and Moment Properties of Various GARCH and Stochastic Volatility” avec Xiaohong Chen, présenté à the conférence Journées de Statistique (Fez, Maroc, mai 2000).

“Policy evaluation in macroeconometric doubly stochastic models” avec Stéphane Grégoir, présenté à the conférence “Econometrics of Policy Evaluation” (Paris, janvier 2000).

“Efficient GMM Estimation Using the Empirical Characteristic Function” (with Jean-Pierre Florens), présenté à the World Congress of the Econometric Society (Seattle, août 2000) et la conférence “Paris-Berlin” (Garchy, septembre 2000).

“Spectral method for deconvolving a density” (with J.P. Florens), présenté à NBER-NSF CEME (Rochester, mai 2001), the Econometric Society Meeting (Atlanta, Janvier 2002), ISI conférence (Sydney, avril 2005), et la conférence en l’honneur de Jean-Jacques Laffont (Toulouse, juillet 2005).

“Tests for unit-root versus Threshold specification with an application to the PPP” (avec Frédérique Bec et Mélika Ben Salem), présenté à the Canadian Economic Association (Montréal, juin 2001), the Econometric Society Meeting (Los Angeles, juin 2002).

“Detecting Mean Reversion in Real Exchange Rates: Evidence from a Multiple Regime STAR Specification” (avec Frédérique Bec et Mélika Ben Salem), présenté à the 10th Annual Symposium of the Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics (Atlanta, mars 2002), at the Midwest Econometrics Group conference (Chicago, octobre 2004).

“On the asymptotic efficiency of GMM” avec JP Florens, présenté à the Information and Entropy Econometrics conference (Washington DC, octobre 2003), the Econometric Society Winter Meetings (San Diego, janvier 2004), et la conférence CIRANO et CIREQ sur les Operator Methods (Montréal, novembre 2004).

“Optimal Tests for Markov Switching” (avec L. Hu et W. Ploberger), présenté à Society of Economic Dynamics conference (Florence, juillet 2004), the Econometric

Study Group conference (Bristol, July 2004), NBER-NSF Time Series conference (Montreal, septembre 2006), EC2 conference (Faro, décembre 2007).

“Instrumental Variables Estimators based on Principal Components”, renommé “A regularization approach to the many instruments problem” présenté à NBER-NSF CEME (Cambridge, mars 2005), the European Econometric Society meeting (Vienne, août 2006), Canadian Econometric Study Group (Niagara Falls, octobre 2006), Econometric Society (Chicago, janvier 2007), the Econometric Study Group Conference (Bristol, July 2007), CIREQ conference on GMM (Montréal, novembre 2007), Operator Methods and Inverse Problems in Econometrics (Cowles Foundation, juin 2008).

“Efficient Estimation using the Characteristic Function” (avec R. Kotchoni), présenté à Econometric Study Group conference (Bristol, juillet 2008).

“Assessing the Nature of Pricing Inefficiencies via Realized Measures” (avec R. Kotchoni), présenté au North American Summer Meeting of the Econometric Society (Boston, juin 2009).

“Optimal Portfolio Selection with Regularization” (avec N. Noumon), présenté à Fourth CIREQ Time series conference (Montréal, mai 2010), CEA (Québec, mai 2010), NBER-NSF Time Series conference (Duke, octobre 2010), Conférence “Information Theory and Shrinkage Estimation” (Info-Metrics Institute, Washington DC, novembre 2011), CESH (Queen’s university, octobre 2012).

“Regularized Generalized Empirical Likelihood Estimators” (avec R. Kotchoni), présenté à the Info-Metrics conference (American University, septembre 2010).

“Regularized LIML for many instruments” (avec Guy Tchuente) présenté à the CIREQ conference on High Dimensional Problems in Econometrics (Montréal, Mai 2012), conférence en honneur de Jean-Pierre Florens (Toulouse, septembre 2012), CESH (Waterloo university, Octobre 2013).

“In-sample inference and forecasting in misspecified factor models” (avec Barbara Rossi) présenté à the Canadian Economic Association (Montréal, Mai 2013), the Infometrics Conference (Washington DC, octobre 2014), congrès annuel de la Société canadienne de science économique (Montréal, mai 2015), World Congress of the Econometric Society (Montréal, août 2015).

“Testing Distributional Assumptions Using a Continuum of Moments” (avec Dante Amengual et Enrique Sentana) présenté à la conférence CIREQ d’économétrie en l’honneur de Jean-Marie Dufour (Montréal, mai 2016).

“A regularization approach to the dynamic panel data model estimation” (joint with Ada Nayihouba), réésenté à NBER-NSF conference (poster, Columbia University, New York, septembre 2016), NY Camp Econometrics (Lake Placid, avril 2017), Canadian Economic Association (Montréal, juin 2018), the International Association for Applied Econometrics (Montréal, juin 2018), the Econometric Study Group, keynote speaker, (Bristol, UK, juillet 2019), et the Canadian Econometric Study Group (Montréal, octobre 2019).

“Functional linear regression with functional response” (avec David Benatia et Jean-Pierre Florens), présenté à the CESG (Western University, octobre 2016) et à l’atelier sur “Inverse problems: theory and statistical inference”, Heidelberg University, Germany (October 2016).

“Testing overidentifying restrictions with many instruments and heteroskedasticity using regularized Jackknife IV” (avec Mohamed Doukali) présenté à the SCSE, Montréal, mai 2018.

“Theoretical Comparison of Functional Principal Component Analysis and Functional Partial Least Squares” (avec Idriss Tsafack) présenté à la SCSE, Québec, mai 2019, EC², Paris, décembre 2020 (virtuel), NBER-NSF Time-Series conference, Rice University, octobre 2021, poster virtuel.

“Choosing the number of instruments for Jackknife instrumental variable estimator” (avec Mohamed Doukali) présenté à la SCSE, Montréal, août 2021.

“Risk Neutral Density Estimation with a Functional Linear Model” (with Idriss Tsafack) présenté à Workshop on high dimensional data analysis, keynote speaker, University Carlos III, Madrid, Spain, septembre 2021 (virtuel).