

# CURRICULUM VITAE

24 janvier  
2017

## DALIBOR STEVANOVIĆ

---

### CONTACT

Courriel : [dstevanovic.econ@gmail.com](mailto:dstevanovic.econ@gmail.com)  
Page web : [www.stevanovic.uqam.ca](http://www.stevanovic.uqam.ca)  
Tél : 1 514 987 3000 # 8374

### DÉTAILS PERSONNELS

Genre : Male  
Citoyenneté actuelle : Canadien  
Langues : Français, Anglais, Serbe

---

### EMPLOIS ET POSITIONS DE RECHERCHE

2016- Professeur agrégé  
Département des sciences économiques, ESG, Université du Québec à Montréal

2012-2016 Professeur adjoint  
Département des sciences économiques, ESG, Université du Québec à Montréal

2012, 2014 Chercheur invité  
Banque de France

2011-2012 Max Weber Fellow  
European University Institute

2010-2011 Chercheur invité  
Economics Department, University of Pennsylvania

2005 Économiste  
Ministère des Finances, Canada

---

### CONSULTANT

2015 Ministère des Finances du Québec

2013 Régie des rentes du Québec

---

### ÉDUCATION

2006-2011 Ph.D. sciences économiques, Université de Montréal

2004-2006 M.A. sciences économiques (avec mention d'honneur), Université Laval

2000-2004 B.A. sciences économiques, Université Laval

---

### CHAMPS DE RECHERCHE

Économétrie, Macroéconomie

---

### ENSEIGNEMENT

ECO8086 (UQAM) Applications de modèles économiques

ECO8620 (UQAM) Économétrie de la finance et applications

ECO8600 (UQAM) Fondements économétriques de la finance

ECO5072 (UQAM) Activité de synthèse

ECO2400 (UQAM) Analyse macréconomique

---

## PUBLICATIONS

1. Factor-Augmented VARMA Models with Macroeconomic Applications, (with Jean-Marie Dufour), *Journal of Business and Economic Statistics*, Volume 31, Issue 4, 2013.
2. Selection of the number of factors in presence of structural instability : a Monte Carlo study,” (with C-O Mao Takongmo) *Identification, Simulation and Finite Sample Inference*, édition spéciale de *L’Actualité Économique*, Revue d’analyse économique, vol. 91, no. 1-2, 2015.
3. Common Time Variation of Parameters in Reduced-Form Macroeconomic Models, *Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*, Volume 20, Issue 2, p.159-183, 2016.
4. An Empirical Study of Credit Shocks Transmission in A Small Open Economy, (with Nathan Bedock), à paraître dans *Canadian Journal of Economics*.
5. The macroeconomic effects of shocks to large banks’ capital, (with Jean-Stéphane Mésonnier), à paraître dans *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*
6. Financial Sector Interconnectedness and Monetary Policy Transmission, (avec Alessandro Barattieri et Maya Eden), accepté dans *Macroeconomic Dynamics*

---

## TRAVAUX DE RECHERCHE

1. Dynamic Effects of Credit Shock in a Data-Rich Environment, (avec Jean Boivin et Marc Giannoni) (Révision demandée *Journal of Business and Economic Statistics*)
2. Factor Augmented Autoregressive Distributed Lag (FADL) Models with Macroeconomic Applications (Révision demandée *Review of Economics and Statistics*)
3. Forecasting U.S. Recessions and Economic Activity, (avec Rachidi Kotchoni)
4. Forecasting in data-rich environment (avec Maxime Leroux et Rachidi Kotchoni)
5. Monetary Transmission in a Small Open Economy : More Data, Fewer Puzzles, (avec Jean Boivin et Marc Giannoni).

---

## TRAVAUX EN COURS

1. Common Sources of Instability in Macroeconomic Dynamics, (avec Pooyan Amir-Ahmadi)
2. MIDAS models and MA components (avec Claudia Foroni et Massimiliano Marcellino)
3. Evaluating the effects of fiscal policies in a data-rich environment (avec Foued Chihi)
4. Risk Sharing, Efficiency of Capital Allocation, and the Connection between Banks and the Real Economy (avec Alessandro Barattieri et Maya Eden)
5. The macroeconomic effects of shocks to large banking groups in the Euro area (avec Jean-Stéphane Mésonnier et Philippe Andrade)

---

## POLICY DOCUMENTS

1. Prévision de l’activité économique au Québec, (avec Maxime Leroux et Rachidi Kotchoni), Rapport de projet 2016RP-08, CIRANO, 2016.
2. Analyse du cout de la vie des ménages : Comparaison entre Montréal et d’autres villes nord-américaines, (avec Jean-Denis Garon), Rapport d’expertise indépendante réalisé pour le compte de la Centrale des Syndicats Nationaux, 2014.
3. Évolution macroéconomique de l’économie québécoise : Une analyse autorégressive vectorielle (VAR), (avec Kevin Moran), Rapport de recherche réalisé pour le compte de la Régie des rentes du Québec, 2014.

---

## ARTICLES DANS LES COMPTE-RENDUS DE COLLOQUES

“Analyse du choix modal concernant les déplacements domicile-travail à l’aide d’un modèle logit mixte”,  
*Revue des routes & transports*, volume Le choix du développement durable, June 2007.

---

## SÉMINAIRES INVITÉS

1. Collegio Carlo Alberto, Torino, June 2016
  2. National Bank of Serbia, Belgrade, Mai 2015
  3. Banque de France, Paris, Juin 2014
  4. Banque de France, Paris, Juin 2013
  5. Banque du Canada, Ottawa, Mars 2013
  6. Université Laval, Québec, Septembre 2012
  7. Koc University, Istanbul, Avril 2012
  8. Banque de France, Paris, Mars 2012
  9. European Central Bank, Francfort, Février 2012
  10. Banque de France, Paris, Décembre 2011
  11. European University Institute, Florence, Novembre 2011
  12. Bank of Canada, Ottawa, Février 2011
  13. Université Laval, Montréal, Janvier 2011
  14. Université du Québec à Montréal, Janvier 2011
  15. University of Pennsylvania, Philadelphia, Décembre 2010
  16. Columbia University, New York, Décembre 2010
- 

## CONFÉRENCES

1. International Association for Applied Econometrics Annual Conference, Milano, Juin 2016
2. 50th Annual Meeting of the CEA, Ottawa, Mai 2016
3. 56e Congrès de la SCSE, Québec, Mai 2016
4. Econometric Society Winter Meetings, San Francisco, Janvier 2016
5. Econometric Society World Congress, Montréal, Aout 2015
6. 3th Rimini Time Series Conference, Rimini, Juin 2015
7. International Association for Applied Econometrics Annual Conference, Thessalonique, Juin 2015
8. Barcelona GSE Summer Forum, Barcelona, Juin 2015
9. Vienna Time Series Conference, Vienna, Mai 2015
10. 55e Congrès de la SCSE, Montréal, Mai 2015
11. *EC<sup>2</sup>* Conference, Barcelona, Decembre 2014
12. International Association for Applied Econometrics Annual Conference, London, Juin 2014
13. Barcelona GSE Summer Forum, Barcelona, Juin 2014
14. 48th Annual Meeting of the CEA, Vancouver, Mai 2014
15. 54e Congrès de la SCSE, Ottawa, Mai 2014
16. Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics Conference, New York City, Avril 2014
17. Large-Scale Factor Models in Finance Conference - SoFiE, Lugano, Octobre 2013

18. 45<sup>th</sup> Annual Money Macro and Finance Conference, London, Septembre, 2013
19. 28<sup>th</sup> Annual Congress of the European Economic Association, Gothenburg, August 2013
20. International Banking, Economics and Finance Association Summer Meeting, Seattle, June 2013
21. International Finance and Banking Society 5<sup>th</sup> International Conference : "The Search for Financial Stability : Models, Policies and Prospects", Nottingham, UK, June 2013
22. Atelier en macroéconomie CIRPÉE-DEEP-TSE, Toulouse, Juin 2013
23. Econometric Society Winter Meetings, San Diego, Janvier 2013
24. AEA Meetings, San Diego, Janvier 2013
25. Second Conference of the Macro-prudential Research network of the European System of Central Banks, ECB, Frankfurt, Octobre 2012
26. Journée du CIRPÉE, Septembre 2012
27. 18th International Panel Data Conference, Paris, July 2012
28. After (?) the Storm : Lessons from the Great Recession, Rimini, Mai 2012
29. 52e Congrès de la SCSE, Mont-Tremblant, Mai 2012
30. 6th Time Series CIREQ Conference, Montréal, Mai 2012
31. EC<sup>2</sup> Conference, EUI, Florence, Décembre 2011
32. 17th International Panel Data Conference, Montréal, Juillet 2011
33. 45th Annual Meeting of the CEA, Ottawa, Juin 2011
34. 5th Time Series CIREQ Conference, Montréal, Mai 2011
35. 51e Congrès de la SCSE, Sherbrooke, Mai 2011
36. Econometric Society Winter Meetings, Denver, Janvier 2011
37. 4th Time Series CIREQ Conference, Montréal, Mai 2010
38. 44th Annual Meeting of the CEA, Québec, Mai 2010
39. Factor Models in Economics and Finance, Cass Business School, London, Décembre 2009
40. Canadian Econometric Study Group Conference, Ottawa, Septembre 2009
41. NBER-NSF Time Series Conference, Davis, Septembre 2009
42. 49e Congrès de la SCSE, Mont St-Gabriel, Mai 2009
43. 14th International Conference on Computing in Economics and Finance, Paris, Juin 2008
44. 42nd Annual Meeting of the CEA, Vancouver, Juin 2008

---

## ORGANISATION DES CONFÉRENCES

Ateliers de recherche sur le thème "Factor analysis in economics and finance", lors des Congrès annuels de l'AEC : 2010, 2011 et 2013.

Membre du comité scientifique : Congrès annuels de l'AEC 2014.

---

## ARBITRES

*Review of Economics and Statistics, Journal of Business & Economic Statistics, Journal of Econometrics, Journal of International Economics, Journal of Applied Econometrics, Journal of Financial Econometrics, International Journal of Forecasting, Canadian Journal of Economics, Journal of Applied Economics, Empirical Economics, Computational Statistics & Data Analysis, Journal of Forecasting*

---

## SUBVENTIONS DE RECHERCHE

2015-2017	CRSH, Développement Savoir
2014-2017	FRQSC, Établissement de nouveaux professeurs
2014-2018	FRQSC, Subvention d'équipe
2014	Visiting scholar grant, Fondation de la Banque de France
2013	FODAR, Université du Québec
2012	PAFARC, UQAM
2012	Visiting scholar grant, Fondation de la Banque de France

---

## BOURSES ET PRIX

2010-2011	Bourse de fin de doctorat, Université de Montréal
2007-2010	Bourse d'études supérieures du Canada, CRSH
2007-2010	Bourse de doctorat en recherche, FQRSC
2006-2007	Bourse de doctorat, Université de Montréal
2007	Concours AIPCR : deuxième prix
2007	Bourse de l'AQTR
2004-2005	Bourse de maîtrise, Université Laval

---

## SUPERVISION DES ÉTUDIANTS

### Ph.D. Dissertations

1. Mouna Landoulsi (avec Alessandro Barattieri)

### Master's Thesis

1. Maxime Leroux, "Chocs de dépenses gouvernementales aux Etats-Unis : effets et anticipations fiscales". Position actuelle : Économiste, Ministère des Finances du Canada
  2. Benoit Vincent, "Mesure en temps réel de l'économie canadienne : construction d'un indice journalier". Position actuelle : Économiste, Banque du Canada
  3. Olivier Fortier-Gagnon, "L'incertitude macroéconomique au Canada et au Québec". Position actuelle : Économiste, Ministère des Finances Québec.
  4. Adantchede Martinien Dansou "La récession économique de 2007 à 2009 au Canada et aux Etats-Unis : une étude à partir d'un modèle à facteurs". Position actuelle : Économiste, Bénin.
  5. Rebecca Kanga, "Évaluation empirique des effets macroéconomiques des politiques budgétaires au Canada".
  6. Marie-Chantal Landry, "Étude d'hétérogénéité des effets et de la transmission des politiques budgétaire et fiscale au Québec".
  7. Alexandre Fontaine, "L'écart partisan canadien : une approche économétrique".
  8. Hamidou Mbaye, "Prévision du taux de change dans un environnement riche en données".
- 

## COMITÉ DE THÈSE

Examineur interne Jeremy Chaudourne (2013), Salaheddine El Omari (2013).

Examineur externe Alexandre Kopoin (2014, Université Laval), Nérée Noumon (2013, Université de Montréal).

---

## AUTRE

- 2014 - Examineur interne : FRQSC, Établissement de nouveaux professeurs  
2013 - Conseil d'administration, Société canadienne de sciences économiques
- 

## RÉFÉRENCES

### **Jean Boivin**

Deputy Governor  
Bank of Canada  
Phone : (1) 613 782 8278  
Email : [jboivin@bank-banque-canada.ca](mailto:jboivin@bank-banque-canada.ca)

### **Francis X. Diebold**

Department of Economics  
University of Pennsylvania  
Phone : (215) 898 1507  
Email : [fdiebold@sas.upenn.edu](mailto:fdiebold@sas.upenn.edu)  
Webpage : <http://www.ssc.upenn.edu/~fdiebold>

### **Jean-Marie Dufour**

Department of Economics  
McGill University  
Phone : (1) 514 398 8879  
Email : [jean-marie.dufour@mcgill.ca](mailto:jean-marie.dufour@mcgill.ca)  
Webpage : [www.jeanmariedufour.ca](http://www.jeanmariedufour.ca)

### **Marc Giannoni**

Senior Economist  
Macroeconomic and Monetary Studies Function  
Federal Reserve Bank of New York  
Phone : 212 720 6518  
Email : [marc.giannoni@ny.frb.org](mailto:marc.giannoni@ny.frb.org)