



DÉPARTEMENT DE FINANCE

Journée finance – Semaine de la recherche 2008


FACULTÉ D'ADMINISTRATION
UNIVERSITÉ DE SHERBROOKE

Mercredi – 2 avril 2008

8h30 - 16h35 [K1-2045 et K1-2046]

JOURNÉE FINANCE


Université de Sherbrooke



8h30 – 8h50

Accueil


Café - Croissants



8h50 – 10h45

PRÉSENTATIONS DES ÉTUDIANTS


Responsable des sessions Claudia Champagne



8h50 – 9h10

Programmation génétique pour créer des règles d'analyse technique optimales


Philippe Ostiguy, étudiant à la M.Sc. Finance [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]



9h10 – 9h30

Vers un modèle intégré d'analyse des risques d'entreprise : Une adaptation du RAROC


Ricardo Vincente, étudiant au DBA [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]



9h30 – 9h50

La méthodologie d'études d'événements: un modèle de valorisation des pratiques d'affaires dans les entreprises biomédicales

Jean-Claude Macena, étudiant au DBA [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]



9h50 – 10h05

PAUSE

10h05 – 10h25

Pratiques de gouvernance des SCR au Québec, entre réalités et modèles théoriques

Patrick Mbassegué, étudiant au DBA [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

10h25 – 10h45

Le régime forestier de la Colombie-Britannique : la gestion forestière par objectifs et résultats

Marc Dubé, étudiant au DBA [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

10h45 – 11h00

PAUSE

MERCREDI – 2 AVRIL (suite)

11h00 – 12h00

FINANCE SOCIALEMENT RESPONSABLE

Responsable de la session Jacques Préfontaine

11h00 – 11h20

Théories et pratiques en finance socialement responsable

Jacques Préfontaine, UdeS [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

11h20 – 11h40

Développement durable et coût social du capital

Marc-André Lapointe, UdeS [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

11h40 – 12h00

Évaluation extrafinancière et développement durable

Dominique Wolff, ESCEM Tours, France [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

DÎNER-CONFÉRENCES

FINANCE SOCIALEMENT RESPONSABLE

12h15 – 12h55

Formulation et mise en œuvre de la politique d'investissement responsable à la CDPQ

Ginette Depelteau, Vice-Présidente principale, Politiques et conformité, CDPQ [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

FINANCE DE MARCHÉ

13h00 – 13h40

Optimal execution for portfolio transitions

Pierre Chamberland, Vice-Président, Portfolio and Risk Management Group, State Street Boston [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

Mark Kritzman, State Street Boston

Simon Myrgren, State Street Boston

Sébastien Page, State Street Boston

13h40 – 14h00

PAUSE

MERCREDI – 2 AVRIL (suite)

14h00 – 15h00

CAPITAL DE RISQUE

Responsable de la session Jean Desrochers

14h00 – 14h20

Le suivi des investissements par les SCR : approches et outils

Serge Nomo, UQTR [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

14h20 – 14h40

Responsabilité sociale et environnementale, certifications et performances financières

Bouchra M'Zali, UQAM [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

14h40 – 15h00

Gestion de risque à deux signaux : la VAR conditionnelle mensuelle et sa tendance à long terme

Frank Coggins, UdeS [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

Alexis Morin, UdeS

15h00 – 15h15

PAUSE

15h15 – 16h35

VALEUR AJOUTÉE EN GESTION DE PORTEFEUILLE

Responsable de la session Frank Coggins

15h15 – 15h35

The Performance of a "Forward Hedge Rule": Evidence from a Canadian Institutional Investor Perspective

Olfa Hamza, CDPQ

Jean-François L'Her, CDPQ

Mathieu Roberge, CDPQ [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

15h35 – 15h55

Syndicated Loans : How Much Do Borrowers Lose To Information Symmetries Between Syndicate Members ?

Claudia Champagne, UdeS [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

15h55 – 16h15

Application de fonctions copules à la finance de marché

Pierre Bouvier, UdeS [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]

16h15 – 16h35

Sur la variabilité des prix et des valeurs sous-jacentes des fonds communs de placement à capital fixe

Frank Coggins, UdeS

Yves Trudel, UdeS [[acétates.pdf](#)][[papier.pdf](#)]