

MERCI À NOS PARTENAIRES :

- Fonds Conrad-Leblanc
- Département de finance, assurance et immobilier
- Chaire RBC en innovations financières
- Chaire d'assurance et de services financiers L'Industrielle-Alliance
- Chaire Groupe Investors en planification financière
- Salles des marchés Carmand-Normand et Jean-Turmel
- École de comptabilité

Conférence organisée par le
Laboratoire d'ingénierie financière de l'Université Laval
www.fsa.ulaval.ca/labiful/

«La gestion du risque dans l'ère de Bâle III »



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Vision et mission

- › Le Laboratoire d'ingénierie financière de l'Université Laval (LABIFUL) est un centre d'excellence de recherche et de formation pour la promotion et la vulgarisation des techniques et méthodes d'ingénierie financière.



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Objectifs spécifiques

1. Promouvoir l'excellence de la recherche et l'application des méthodes quantitatives à la finance et contribuer à l'avancement des connaissances en ingénierie financière;
2. Contribuer à la formation des compétences de pointe en ingénierie financière;
3. Être un acteur clé de vulgarisation des instruments financiers de gestion et de transfert alternatif des risques auprès des acteurs de l'industrie financière;
4. Établir et maintenir des collaborations étroites entre les chercheurs, étudiants et professionnels de l'industrie financière;
5. Devenir un centre multidisciplinaire et interuniversitaire de recherche par excellence en ingénierie financière.



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Activités de formation 2011-2012

- › Atelier sur la modélisation financière à l'aide de Matlab
 - Nabil Ouazzani, Revenu Québec
- › Atelier sur la modélisation financière à l'aide d'Excel
 - Marc L. Michaud, Mouvement Desjardins
- › Utilisation du logiciel SAS en finance
 - Slim Eleuch, Banque Nationale Groupe financier



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Activité à venir

- **Formation en simulations Monte Carlo (en collaboration avec PRMIA)**
- Pour information et inscription:
 - www.fsa.ulaval.ca/labiful/ ou
 - www.prmia.org
 - Ou simplement contacter moi



UNIVERSITÉ
LAVAL
Faculté des sciences
de l'administration

Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Conférence annuelle du Labiful

- Initiation d'une série de conférences sur un sujet d'actualité
- Important d'avoir le point de vue des praticiens de l'industrie financière



UNIVERSITÉ
LAVAL
Faculté des sciences
de l'administration

Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Présentateurs

Christian-Marc Panneton, M.Sc., FSA, FCIA, CFA, CERA

Expériences professionnelles

- Gestionnaire des risques financiers pour l'Industrielle-Alliance. Son rôle consiste principalement à identifier et quantifier les risques financiers présents au bilan de la compagnie et par la suite à élaborer et mettre en œuvre des stratégies de gestion de ces risques incluant ou non l'utilisation de produits dérivés. La couverture dynamique des garanties des fonds distincts est actuellement un de ses mandats principaux. La gestion des risques inclus aussi la conception des techniques d'appariement utilisées par la compagnie.
- Participe activement à plusieurs comités et sous-comités de la Société des Actuaire et de l'Institut Canadien des Actuaire.
- Il a joint en 1991 le comité d'éducation et d'examen de la Société des Actuaire pour s'en retirer en 2010 après avoir complété son mandat à titre de président de ce comité.
- Chargé de cours pour l'École d'actuariat de 1992 à 2002.

Qualifications

- Baccalauréat en actuariat de l'Université Laval
- Maîtrise en Mathématiques (Actuariat) de l'université Laval
- Fellowship de la Société des Actuaire
- Fellow de l'Institut Canadien des Actuaire
- CFA, CERA



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Présentateurs

Paul Angoua, ISE, DEA, MBA

Expériences professionnelles

- Directeur principal à la Banque Nationale du Canada en charge d'une équipe de professionnels responsable du développement et de la gestion de tous les modèles et paramètres de risque de crédit pour tous les portefeuilles de crédit de la Banque (commercial et particulier). Au sein de cette Banque depuis 2004, il a occupé successivement les postes d'Analyste Senior, d'Analyste Principal et de Directeur respectivement en stratégie de crédit aux PME et en modélisation du risque de crédit du commercial.
- Avant de commencer sa carrière en Finance, il a été enseignant-chercheur à l'ENSEA d'Abidjan en Côte d'Ivoire de 1999 à 2002 où il a notamment dispensé les cours de méthodes quantitatives (probabilité-statistiques & économétries) et finance internationale.
- Coauteur avec les profs. V. S. Lai et I. Soumaré de l'U. Laval de l'article « Project Risk Choices under Privately Guaranteed Debt Financing » publié dans le Quarterly Review of Economics & Finance (2008).

Qualifications

- MBA en finance de l'Université Laval
- DEA en Économie et Finance Internationale de l'Université Paris-Dauphine en France
- Diplôme d'Ingénieur Statisticien-Économiste de l'ENSEA d'Abidjan en Côte d'Ivoire
- Licence en science mathématique de l'Université d'Abidjan-Côte d'Ivoire
- À chacun de ses diplômes, il a été sur le tableau d'honneur particulièrement à l'Université Laval où il a été sur le tableau d'honneur de la FSA successivement en 2003 et en 2004.



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Présentateurs

Mohamed Kortas, M.Sc., CFA, FRM, CAIA

Expériences professionnelle

- Directeur conseil, Recherche à la Caisse de dépôt et placement du Québec. Il a pour mandat principal de contribuer à l'offre de services aux déposants sur les catégories d'actif peu liquides, notamment les placements privés et les infrastructures. Il est responsable des prévisions de rendement et de risque à long terme pour les portefeuilles spécialisés Placements privés et Infrastructures. Il a aussi pour responsabilité d'enrichir l'expertise du groupe en recherche empirique appliquée à des projets reliés aux placements privés et de collaborer à des mandats de recherche pour la haute direction.
- Publications: *Journal of Private Equity* (2003), *Canadian Investment Review* (2004), *Emerging Markets Review* (2005, 2006), *Journal of Investing* (2006).
- Il a participé en mai 2005 à une conférence internationale sur les marchés émergents à Londres, où il a présenté un article qui traite des stratégies d'investissement dans les pays émergents.
- Il a enseigné des cours de finance d'entreprise et de finance internationale à HEC Montréal de 1998 à 2002. Il est entré à la Caisse de dépôt et placement du Québec en 2002.

Qualifications

- Maîtrise de HEC Montréal
- Chartered Financial Analyst (CFA)
- Financial Risk Manager (FRM)
- Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA)



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Présentateurs

Francis Mensah, MBA, CFA, CMA

Expériences professionnelles

- Directeur, Comptabilité de trésorerie à Exportation et Développement Canada (EDC), où il a été auparavant Directeur principal de la gestion de l'actif et du passif, Directeur de la gestion des risques de marché, Directeur de la gestion des risques de crédit et Directeur des normes de crédit.
- Il enseigne également à temps partiel à l'UQAM, à l'UQO, au MBA Exécutif de l'École de gestion Telfer de l'Université d'Ottawa. Il y enseigne plusieurs cours dans les domaines de la comptabilité, de la gestion de portefeuille, des produits dérivés et de la gestion des institutions financières.
- Ses domaines d'intérêts sont les applications des produits dérivés, l'évaluation des instruments financiers, la gestion des risques et la valeur à risque (VaR).

Qualifications

- MBA en finance de l'Université Laval
- CFA & CMA



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Merci à nos partenaires

- › Fonds Conrad-Leblanc
- › Département de finance, assurance et immobilier
- › Chaire RBC en innovations financières
- › Chaire d'assurance et de services financiers
L'Industrielle-Alliance
- › Chaire Groupe Investors en planification financière
- › Salles des marchés Carmand-Normand et Jean-Turmel
- › École de comptabilité



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/

Quelques points à retenir de la conférence



Laboratoire d'ingénierie financière

www.fsa.ulaval.ca/labiful/