

Conférence du Laboratoire d'ingénierie financière de l'Université Laval
(LABIFUL)
30 mars 2012

La gestion du risque dans l'ère de Bâle III

Van Son Lai, Ph.D., P. Eng. (Brit. Col.), CFA
Professeur titulaire, Université Laval
Gestionnaire du Fonds Conrad Leblanc
Codirecteur Laboratoire d'ingénierie financière
LABIFUL www.fsa.ulaval.ca/labiful/

- Introduction de Van Son Lai, Codirecteur LABIFUL
- **Gestion intégrée des modèles du risque de crédit sous Bâle II dans un contexte d'instabilité financière**
Paul Angoua, ISE, DEA, MBA
Banque Nationale du Canada
- **Estimation du risque économique des placements privés et d'infrastructures**
Mohamed Kortas, M. Sc., CFA, FRM, CAIA
Caisse de dépôt et placement du Québec

Paul Angoua, ISE, DEA, MBA

▪ Expériences professionnelles

- Banque Nationale du Canada/ Stratégie d'Entreprise et Modélisation des Risques, Directeur Principal- Modèles et Paramètres de Risque Réglementaire 2009-présent.
- Directeur- Modèles et Paramètres de Risque du Commercial 11-2010 au 05-2010
- Banque Nationale du Canada/ Gestion du risque de crédit aux entreprises, Analyste Principal/Équipe Analytique et modélisation 07-2004 au 10-2009

▪ Qualifications

- MBA Finance, Université Laval,
- DEA d'Économie et Finance internationales, Paris IX-Dauphine, Paris, France
- Ingénieur Statisticien-Économiste, ENSEA, Côte d'Ivoire

Paul Angoua, ISE, DEA, MBA (Laval)

▪ Qualifications

- Licence ès sciences mathématiques, Université d'Abidjan, Côte d'Ivoire,
- Inscrit au tableau d'honneur à l'obtention de chacun de ces diplômes

▪ Publications

- Project Risk Choices under Privately Guaranteed Debt Financing, *Quarterly Review of Economics and Finance*, 48 (1), p.123-152, Feb 2008 (avec Van Son Lai et Issouf Soumaré)
- Entreprises Privées et emploi en Côte d'Ivoire, dans série recherches Université de Bordeaux VI N°6, Bordeaux, France 2001
- Économie Locale de la Région d'Odienné (Côte d'Ivoire), publié dans les cahiers de recherches de l'OCDE et du Club de Sahel, 2001

- Introduction de Van Son Lai, Codirecteur LABIFUL
- **Gestion intégrée des modèles du risque de crédit sous Bâle II dans un contexte d'instabilité financière**
Paul Angoua, ISE, DEA, MBA
Banque Nationale du Canada
- **Estimation du risque économique des placements privés et d'infrastructures**
Mohamed Kortas, M. Sc., CFA, FRM, CAIA
Caisse de dépôt et placement du Québec

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

- **Expériences professionnelles**
 - Directeur Conseil, Recherche
Caisse de dépôt et placement du Québec
(à CDP depuis 2002)
 - Offre de services aux déposants sur les catégories d'actif peu liquides, notamment les placements privés et les infrastructures
 - Responsable des prévisions de rendement et de risque à long terme pour les portefeuilles spécialisés Placements privés et Infrastructures
 - 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

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

▪ Qualifications

- M. Sc., HEC-Montréal
- CFA, FRM, CAIA

▪ Publications

- A publié des articles dans des revues professionnelles et scientifiques (Journal of Private Equity 2003, Canadian Investment Review, 2004; Emerging Markets Review, 2005, 2006; Journal of Investing, 2006, 2007).
- M. Kortas, J-F. L'Her et M. Roberge, 2005, Country selection of emerging equity markets: Benefits from country attribute diversification, *Emerging Markets Review*, 1-19.

Séminaire Fonds Conrad-Leblanc 2012

- ***Catastrophes and the Agency Limits of Diversification***
- **Jeudi 19 avril 2012**, 11 h à 12 h 20
Salon Hermès (salle 1651), Pavillon Palasis-Prince
Kenneth A. Froot, Ph.D.
Andre R. Jakurski Professor of Business Administration
Director of Research, Harvard Business School, USA
- Conférencier de renommée internationale, le coauteur du célèbre modèle Froot, Scharfstein et Stein (1993), Froot et Stein (1998)
- Risk management, finance internationale, risque CAT.
- Founding partner of FDO Partners, LLC and State Street Associates.