

**Conférence du Laboratoire d'ingénierie financière de l'Université Laval
(LABIFUL)
1 mars 2013**

Gestion des risques et produits dérivés postcrise

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

- Introduction de Van Son Lai, Codirecteur LABIFUL
- **Évaluation des produits dérivés postcrise de crédit**
Hassan Ait El Trach, B. Ing., MBA, CFA
Banque Nationale Groupe financier
- **Méthodologie du calcul de la VaR de marché: revue de l'approche basée sur des simulations historiques**
Asshvin Gajadharsingh, B. Ing., M. Sc. (ing. fin.), Ph. D.
Caisse de dépôt et placement du Québec

Hassan Ait El Trach, B.Ing., MBA (Laval), CFA

■ Expériences professionnelles

- Senior Manager, Market Risk, National Bank Financial Group, Risk Analytics, 2007-Present
- Senior Manager, Middle Office & Market Risk, National Bank Financial Group, ALM/Banking Book and Projects & Risk Analysis, 2007-2012
- Section Manager, Middle Office & Market Risk, National Bank of Canada, Special Projects, 2004-2007
- Senior Analyst, Middle Office & Market, National Bank of Canada, Fixed Income & Financial Engineering, 2002-2004

■ Qualifications

- MBA, Finance, Université Laval
- Ingénieur, ENIM, Maroc
- CFA
- Récipiendaire des bourses et mérites (IFM2, FIMAT, Ernst & Young)

Asshvin Gajadharsingh, B. Ing., M. Sc. (ing. fin.), Ph. D.

■ Expériences professionnelles

- Conseiller Principal, Mesure et analyse quantitative du risque
Caisse de dépôt et placement du Québec
(à CDP depuis 2008)

■ Qualifications

- M. Sc. (ing. fin.), Université Laval
- Ph.D. (Physique), Université Laval
- B.Sc. (Génie Physique), Université Laval

■ Publications

- «Réplication d'obligations risquées avec des modèles d'options», (A. Gajadharsingh et V.S. Lai), *Assurances et gestion des risques*, 2009, Lead article, 1-20.
- Articles dans [Optics Communications](#)

Séminaire Fonds Conrad-Leblanc 2013

www.fsa.ulaval.ca/CONRAD-LEBLANC

- **Implications and Opportunities Presented by the Securitization of Catastrophe (Re)insurance**
- **Vendredi 5 avril 2013**, 11 h à 12 h 20
Salle 1317, Pavillon Palasis-Prince
- **M. Morton N. Lane, Ph. D.**
- [Président, Lane Financial LLC](#)
- M. Lane est une sommité internationale dans le monde de l'assurance et de la titrisation.
- [Alternative \(Re\)insurance Strategies](#) vient d'être réédité chez Risk Water Group.
La première édition, Alternative Risk Strategies (2002), est largement reconnue comme normes de l'industrie pour les professionnels en réassurance.