

LES TRAVAUX ET ACTIVITÉS DE LA CHAIRE EN ASSURANCE L'INDUSTRIELLE-ALLIANCE

Gilles Bernier

Volume 68, numéro 1, 2000

URI : <https://id.erudit.org/iderudit/1105307ar>

DOI : <https://doi.org/10.7202/1105307ar>

[Aller au sommaire du numéro](#)

Éditeur(s)

HEC Montréal

ISSN

0004-6027 (imprimé)

2817-3465 (numérique)

[Découvrir la revue](#)

Citer ce document

Bernier, G. (2000). LES TRAVAUX ET ACTIVITÉS DE LA CHAIRE EN ASSURANCE
L'INDUSTRIELLE-ALLIANCE. *Assurances*, 68(1), 135–140.
<https://doi.org/10.7202/1105307ar>

CHRONIQUE DES CHAIRES EN ASSURANCE ET EN GESTION DES RISQUES

par Gilles Bernier

LES TRAVAUX ET ACTIVITÉS DE LA CHAIRE EN ASSURANCE L'INDUSTRIELLE-ALLIANCE

Projets de recherche subventionnés en 1998-1999

- Hélène COSSETTE et Étienne MARCEAU :
(École d'actuariat, Université Laval)
« Étude et application de modèles de dépendance entre risques en actuariat IARD »
- Lucie COURTEAU et Robert MATHIEU :
(Faculté des sciences de l'administration, Université Laval)
« Le contenu informationnel des nouvelles normes comptables sur les instruments financiers »
- Étienne MARCEAU :
(École d'actuariat, Université Laval)
« Étude et application de modèles de taux d'intérêt dans l'évaluation de produits d'assurance-vie »

Subvention additionnelle versée en 1998-1999 sur un projet existant¹

- Louis DORAY* et Andrew LUONG** :
* (Département de mathématiques et de statistique, Université de Montréal)
** (École d'actuariat, Université Laval)
« Méthodes de distance quadratique généralisées et valeurs extrémales en réassurance »

L'auteur :

Gilles Bernier est titulaire de la Chaire en assurance l'Industrielle-Alliance de l'Université Laval.

Bourses de recherche (2^e cycle) de la Chaire en assurance L'Industrielle-Alliance

(Remise du 31 mars 1999)

- Véronique MARTEL :
Maîtrise avec essai-concentration en droit de l'entreprise
« *Les engagements formels* » (essai)
Bourse : 1 000\$ (Bourse André-Lévesque)
- Issouf SOUMARÉ :
Maîtrise spécialisée en ingénierie financière
« *La gestion d'un portefeuille de garanties avec corrélations
non nulles entre les firmes garanties* » (mémoire)
Bourse : 2 000\$ (Chaire en assurance
L'Industrielle-Alliance)

Bourses de l'Institut d'Assurance du Canada (1^{er} et 2^e cycles)

(Remise du 19 mai 1999)

Bourses d'études (1^{er} cycle – Baccalauréat en administration des affaires) :

- François R. BEAUDOIN :
Bourse : 800\$
- Christine FILLION :
Bourse : 800\$
- Pascal-André RHEAULT :
Bourse : 800\$

Bourses de recherche (2^e cycle – Maîtrise en administration des affaires – Option finance) :

- Vincent CASTONGUAY :
« *Développement d'un système de mesure et de gestion des
risques pour une coopérative financière péruvienne* » (essai)
Bourse : 1 300\$
- Karim DRIRA :
« *La réplication synthétique du risque de crédit d'un porte-
feuille de prêts* » (essai)
Bourse : 1 300\$

Documents produits avec la participation de la Chaire en assurance L'Industrielle-Alliance

Communications

BERNIER, GILLES, ROGER ATINDÉHOU et GUY CHAREST : « Réputation des firmes et réaction boursière en période d'annonce du dividende régulier », *Association française de finance (AFFI)*, Lille (France), 28 juin au 8 juillet 1998.

BERNIER, GILLES, ROGER ATINDÉHOU and GUY CHAREST : « Corporate Reputation and Market Reaction to Changes in Regular Dividends », *Northern Finance Association (NFA)*, Toronto (Canada), September 25-27, 1998.

GENDRON, MICHEL and SONIA CHÂTIGNY : « On the Agreement of Life Insurance Rating Agencies », *American Risk and Insurance Association (ARIA)*, Boston (Massachusetts), August 16-19, 1998.

GENDRON, MICHEL et LUC NAUD : « Les cabinets de courtage IARD au Québec : état actuel du réseau et orientations futures », *Congrès du 20^e anniversaire de l'Association des actuaires I.A.R.D.*, Hôtel L'Estérel, Lac Masson (Les Laurentides, Québec), 28, 29 et 30 mai 1999.

MARCEAU, ÉTIENNE : « Optimization of the Ultimate Ruin Probability in Risk Theory », *33rd Actuarial Research Conference*, Atlanta (Georgia), August 6-8, 1998.

MARCEAU, ÉTIENNE and PATRICE GAILLARDETZ : « The Incidence of Stochastic Interest Rates in Life Insurance Reserves », *Second International IME Congress on Insurance: Mathematics and Economics*, Lausanne (Suisse), July 20-22, 1998.

MOFFET, DENIS : « Fusions et acquisitions en contexte de mondialisation », *Association des actuaires I.A.R.D.*, Hôtel Sheraton, Montréal (Québec), 27 novembre 1998.

Publications

BRUN, JEAN-PIERRE, CLAUDE D. LOISELLE, GENEVIÈVE GAUTHIER et CLERMONT BÉGIN : « Le métier de préventionniste : entre l'arbre et l'écorce – une étude dans les secteurs des pâtes et papiers, de la fabrication de panneaux et des scieries », *Le groupe de communication Sansectra Inc. et Impact Héritage*, juin 1998, 191 pages. (Cette publication résulte d'une étude

subventionnée par l'Institut de recherche en santé et en sécurité du travail du Québec (IRSST) et la Chaire en assurance L'Industrielle-Alliance de l'Université Laval).

- COSSETTE, HÉLÈNE et ÉTIENNE MARCEAU (1999) : « The Discrete-Time Risk Model with Correlated Classes of Business », *Insurance: Mathematics and Economics*, à paraître (les épreuves sont corrigées).
- COSSETTE, HÉLÈNE, MICHEL DENUIT et ÉTIENNE MARCEAU (1999) : « The Impact of Dependence Among Multiple Claims in a Single Loss », *Insurance: Mathematics and Economics*, à paraître (les épreuves sont corrigées).
- COSSETTE, HÉLÈNE, MICHEL DENUIT, J. DHAENE et ÉTIENNE MARCEAU : « Stochastic Approximations of Present Value Functions », *Rapport technique 2000-01 de l'École d'actuariat*. Soumis pour publication.
- COURTEAU, LUCIE, ROBERT MATHIEU et DANIEL ROY : « The Impact of Financial Instrument Disclosure on Publicly Traded Firms », article soumis pour publication au *CA Magazine* (actuellement sous révision).
- D'AVIGNON, GILLES et DANIEL BINETTE : « Réflexions pour un code d'éthique dans les mouvements de véhicules lourds », Rapport présenté à Camo-route Inc. dans le cadre du projet Élaboration d'éléments de base d'un code d'éthique pour conducteurs de véhicules lourds, juin 1998 (révisé en octobre 1998). (Ce document a été produit grâce aux apports financiers de Camo-route Inc. et de la Chaire en assurance L'Industrielle-Alliance).
- DENUIT, MICHEL, CHRISTIAN GENEST et ÉTIENNE MARCEAU : « Criteria for the Stochastic Ordering of Random Sums, with Actuarial Applications », *Rapport technique 99-05 de l'École d'actuariat*. Soumis pour publication.
- GENDRON, MICHEL et GENEVIÈVE CHOQUETTE : « L'accès à l'assurance habitation dans les quartiers centraux : Redlining et conditions socio-économiques », *Assurances*, Vol. 66, No. 4, janvier 1999, pp. 571-607.
- GENDRON, MICHEL et CHRISTIAN GENEST : « On Risk Diversification Through Expert Use », article accepté pour être publié prochainement dans *Advances in Investment Analysis and Portfolio Management (AIAPM)*.
- GENDRON, MICHEL et LUC NAUD : « Les cabinets de courtage IARD au Québec : état actuel du réseau et orientations futures », Document de travail de la Chaire en assurance L'Industrielle-Alliance, septembre 1998.

GENDRON, MICHEL et LUC NAUD : « Étude sur les raisons qui influencent la décision des locataires résidents de ne pas souscrire d'assurance habitation », Rapport final soumis au Bureau d'Assurance du Canada, 14 octobre 1998. Également disponible à la Chaire en assurance L'Industrielle-Alliance sous forme de document de travail.

GENDRON, MICHEL et LUC NAUD : « Les cabinets de courtage au Québec : état actuel du réseau et orientations futures », *Assurances*, Vol. 66, No. 4, janvier 1999, pp. 645-672.

MARCEAU, ÉTIENNE : « Optimization of the Ultimate Ruin Probability in Risk Theory », Proceedings of the 33rd Actuarial Research Conference, *Actuarial Research Clearing House (ARCH)*, 1999.1, pp. 135-163.

MARCEAU, ÉTIENNE, HÉLENE COSSETTE, PATRICE GAILLARDETZ et J. RIOUX (1999) : « Dependence in the Individual Risk Model », Rapport technique 99-01 de l'École d'actuariat, présenté au Third International IME Congress on Insurance : Mathematics and Economics et soumis pour publication.

MARCEAU, ÉTIENNE et PATRICE GAILLARDETZ : « On Life Insurance Reserves in a Stochastic Mortality and Interest Rates Environment », *Insurance: Mathematics and Economics*, Vol. 25, No. 3, 1999, pp. 261-280.

Essais ou mémoires de maîtrise terminés

Sylvain FORTIER :

« *Le délai de réclamation en assurance de la responsabilité civile* »
Avril 1999.

Geneviève GARON :

« *Théorie de la crédibilité : modèles de Bühlmann et de Bühlmann-Straub et applications* »
Décembre 1998.

Caroline GENOIS :

« *La gestion actif-passif des compagnies d'assurance-vie* »
Janvier 1999.

Valérie GUICHARD-DOUCHE :

« *La veille technologique dans les compagnies d'assurance au Canada : les domaines de la veille* »
Août 1998.

Jérôme PANSÉRA :

« Le coût de disparité d'une compagnie d'assurance-vie dans des modèles aléatoires de taux d'intérêt »

Décembre 1998.

Marie-Ethel PLAZANET :

« La veille technologique dans les compagnies d'assurance au Canada : les aspects organisationnels »

Août 1998.

Note

1. Ce deuxième volet généralise les travaux amorcés en 1994 sur les « Méthodes de distance quadratique minimale en assurance ». Ce dernier a d'ailleurs donné naissance à la production de trois articles publiés entre 1995 et 1997 dans des revues telles que *Insurance : Mathematics and Economics*; *Communication in Statistics, Simulation and Computation*.