

LES TRAVAUX ET ACTIVITÉS DE LA CHAIRE EN ASSURANCE L'INDUSTRIELLE-ALLIANCE (1999-2001)

Gilles Bernier

Volume 69, numéro 4, 2002

URI : <https://id.erudit.org/iderudit/1102482ar>

DOI : <https://doi.org/10.7202/1102482ar>

[Aller au sommaire du numéro](#)

Éditeur(s)

HEC Montréal

ISSN

0004-6027 (imprimé)

2817-3465 (numérique)

[Découvrir la revue](#)

Citer ce document

Bernier, G. (2002). LES TRAVAUX ET ACTIVITÉS DE LA CHAIRE EN ASSURANCE L'INDUSTRIELLE-ALLIANCE (1999-2001). *Assurances*, 69(4), 659–668.
<https://doi.org/10.7202/1102482ar>

CHRONIQUE DES CHAIRES EN GESTION DES RISQUES ET ASSURANCES

par Gilles Bernier

LES TRAVAUX ET ACTIVITÉS DE LA CHAIRE EN ASSURANCE L'INDUSTRIELLE-ALLIANCE (1999-2001)

Projets de recherche subventionnés de 1999 à 2001

- Louis ADAM
(École d'actuariat, Université Laval)
«Modélisation de l'inflation et de l'indexation dans un contexte de rendement réel variable relié à l'état de l'inflation»
- Gilles BERNIER
(Département de finance et assurance, Faculté des sciences de l'administration, Université Laval)
«Demande de financement complémentaire dans le cadre d'une activité de formation (APF-21530 – Produits financiers : différents types de placement II)»
- Claire BILODEAU
(École d'actuariat, Université Laval)
«La distribution des excédents d'actif des régimes de retraite»
- Claire BILODEAU et Louis ADAM
(École d'actuariat, Université Laval)
«Valeur ajustée de l'actif»
- Stéphane GAUVIN* et Pierre E. PRÉMONT**
(Faculté des sciences de l'administration, Université Laval)
«eMarketing dans le secteur de l'assurance»
* (Département de marketing)
** (Département des systèmes d'information organisationnels)

L'auteur :

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

- Benny RIGAUX-BRICMONT* et Pierre BALLOFFET**
 - * (Département de marketing, Faculté des sciences de l'administration, Université Laval)
 - ** (Service de l'enseignement du marketing, École des Hautes Études Commerciales, Montréal)
- «Déterminants du processus décisionnel de souscription d'assurance pour l'automobile par les jeunes adultes québécois»*

Remise de bourses privées facultaires du 28 mars 2000

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

- Maxime BABIN
 - Maîtrise en administration des affaires
 - «Démutualisation des compagnies d'assurance vie canadiennes : aspects techniques et caractérisation des premiers appels publics à l'épargne»* (essai)
 - Bourse : 1 000 \$
- Sadok EL GHOUL
 - Maîtrise en administration des affaires
 - «Investigation empirique de la prise de risque en détresse financière»* (essai)
 - Bourse : 1 000 \$

Bourse de recherche (3^e cycle) de la Chaire en assurance L'Industrielle–Alliance

- Frank COGGINS
 - Doctorat en sciences de l'administration
 - «Évaluation de la performance des fonds mutuels à partir de mesures de risque conditionnelles»* (thèse)
 - Bourse : 3 000 \$

Remise des bourses de l'Institut d'Assurance du Canada du 11 avril 2000

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

- Sophie BEAULIEU
 - Bourse : 1 000 \$
- André ST-HILAIRE
 - Bourse : 1 000 \$

Bourse de recherche (2^e cycle – Maîtrise en mathématiques – Actuariat)

- Patrice GAILLARDETZ
«*Structure de dépendance en théorie du risque et pour les obligations avec risque*» (mémoire)
Bourse : 2 000 \$

Remise de bourses privées facultaires du 2 avril 2001
Bourses de la Chaire en assurance L'Industrielle–Alliance

Bourses de recherche (2^e cycle)

- Sandra BUSSOTTO
Maîtrise en administration des affaires
«*Le phénomène de la bancassurance en Europe : présentation des stratégies, facteurs clés de succès et positionnement de quelques grands bancassureurs européens*» (essai)
Bourse : 1 000 \$
- Khemais HAMMAMI
Maîtrise en administration des affaires
«*Couverture des obligations corporatives : stratégie dynamique versus statique et composée versus conventionnelle*» (essai)
Bourse : 1 000 \$
- Amadou Lamine SOW
Maîtrise en administration des affaires
«*Étude de la stratégie de pénétration de la compagnie Sun Life du Canada en Chine*» (essai)
Bourse : 1 000 \$

Bourses de recherche (3^e cycle)

- Fabien CORNILLIER
Doctorat en sciences de l'administration
«*Diversification des risques de taille optimale : vers la consolidation des mutuelles d'assurance santé colombiennes*» (thèse)
Bourse : 3 000 \$
- Omrane GUEDHAMI
Doctorat en sciences de l'administration
«*Réformes économiques, gouvernance d'entreprise et privatisation : le cas des pays en développement*» (thèse)
Bourse : 3 000 \$

Bourses de l'Institut d'Assurance du Canada

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

- Diane VÉZINA
Bourse : 1 000 \$

Bourse de recherche (3^e cycle)

- Najah ATTIG
Doctorat en sciences de l'administration
«*Ultimate Control and Group-Affiliated Firms : The Risk of Expropriation*» (thèse)
Bourse : 3 000 \$

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

Communications (1999 – 2000)

ADAM, Louis : «*Canadian Pensioners Mortality Study 1983-1992*», 34th Actuarial Research Conference, Des Moines (Iowa), August 8-11, 1999.

BERNIER, Gilles : Discussion du papier de Capozza et Sequin : «*Debt, Agency and Management Contracts in REIT's : The External Advisor Puzzle*», Northern Finance Association (NFA), Calgary (Canada), September 24-26, 1999.

LAI, Van Son : «*An Analysis of Private Loan Guarantees : A Revisit*», Northern Finance Association (NFA), Calgary (Canada), September 24-26, 1999.

MARCEAU, Étienne : «*Dependence in the Individual Risk Model*» (with Hélène Cossette, Patrice Gaillardetz and Jacques Rioux), Third International IME Congress on Insurance : Mathematics and Economics, London (Great Britain), July 19-21, 1999.

MARCEAU, Étienne : «*Dependence in the Individual Risk Model*» (with Hélène Cossette, Patrice Gaillardetz and Jacques Rioux), 34th Actuarial Research Conference, Des Moines, (Iowa), August 8-11, 1999.

MARCEAU, Étienne : «*Impact de la dépendance dans le modèle collectif de risque*» (avec Hélène Cossette), Séminaire de l'École d'actuariat, Université Laval (Québec), octobre 1999.

MARCEAU, Étienne : «*Impact de la dépendance dans le modèle collectif de risque*» (avec Hélène Cossette), 15^e Séminaire actuariel de 3^e cycle ISFA Lyon – HEC Lausanne, Université de Lausanne (Suisse), 9 mars 2000.

MARCEAU, Étienne : «*Impact of Dependence in the Collective Risk Model*» (avec Hélène Cossette), Séminaire de l'Institut de Statistique, Université Catholique de Louvain (Belgique), 26 mai 2000.

Communications (2000 – 2001)

BERNIER, Gilles : Président de la *Session C : Comparative Analysis of Risk Management Practices and Performances*, American Risk and Insurance Association (ARIA), Baltimore (Maryland), August 6-9, 2000.

BERNIER, Gilles : Organisateur et modérateur d'une semi-plénière : «*La démutualisation dans le secteur de l'assurance*» impliquant Jacques Henrichon (Inspecteur général adjoint, L'Inspecteur général des institutions financières – Direction générale de la surveillance et du contrôle) et Michel Sanschagrin (Vice-président et directeur général – Administration et actuaire chef, L'Industrielle–Alliance, Compagnie d'assurance sur la vie), Association internationale de management stratégique (AIMS), Université Laval (Québec), 14 juin 2001.

BILODEAU, Claire : «*On the Demographic and Economic Risks of a Pension Plan*», Fourth International Congress on Insurance : Mathematics and Economics, Barcelona (Spain), July 24-26, 2000.

BILODEAU, Claire : «*On the Demographic and Economic Risks of a Pension Plan*», 35th Actuarial Research Conference, Québec (Québec), August 10-12, 2000.

COSSETTE, Hélène : «*Generalized Least Squares Estimators for Credibility Regression Models with Moving Average Errors*» (with Andrew Luong), Fourth International Congress on Insurance : Mathematics and Economics, Barcelona (Spain), July 24-26, 2000.

GENDRON, Michel : «*The Risk of Private Loan Guarantees Portfolios*» (with Van Son Lai and Issouf Soumaré), 35th Actuarial Research Conference, Québec (Québec), August 10-12, 2000.

- LAI, Van Son : «*The Risk of Private Loan Guarantees Portfolios*» (avec Michel Gendron et Issouf Soumaré), Congrès annuel de la Société canadienne de recherche opérationnelle (SCRO/CORS), Québec (Québec), mai 2001.
- LAI, Van Son : «*Chartered Banks' Risk-Taking and Capital Choices Following the Introduction of Official Deposit Insurance in Canada*» (with Jean-Pierre Gueyié), European Financial Management Association (EFMA), Athens (Greece), June 28-July 1st, 2000.
- MARCEAU, Étienne : «*Compound Poisson Approximations for Individual Models with Dependent Risks*», Fourth International Congress on Insurance : Mathematics and Economics, Barcelona (Spain), July 24-26, 2000.
- MARCEAU, Étienne : «*Common Mixtures in the Individual Risk Model*», 35th Actuarial Research Conference, Québec (Québec), August 10-12, 2000.
- MARCEAU, Étienne : «*Stratégies pour construire des approximations par la distribution Poisson composée dans le cadre de modèles individuels avec risques dépendants*», Séminaire de statistique du Département de mathématiques et de statistique de l'Université Laval, octobre 2000.
- MARCEAU, Étienne : «*Approximation par Poisson composée du modèle individuel avec risques dépendants*», Séminaire de l'Institut de statistique et économétrie appliquée de Rabat, octobre 2000.
- MARCEAU, Étienne : «*Stratégies pour construire des approximations par la distribution Poisson composée dans le cadre de modèles individuels avec risques dépendants*», Séminaire de l'École d'actuariat de l'Université Laval, novembre 2000.
- MARCEAU, Étienne : «*Modelling Dependent Risks with Mixture Models*», Congrès annuel de la Société canadienne de recherche opérationnelle (SCRO/CORS), Québec (Québec), mai 2001.

Publications (1999 – 2000)

- ATINDÉHOU, Roger, Gilles BERNIER and Guy CHAREST : «*Corporate Financial Reputation and Market Reaction to Changes in Regular Dividends*», Journal of the Academy of Business Administration, Vol. 5, Nos. 1-2, Spring/Fall 2000, pp. 82-93.

- BÉDARD, Diane : «*Stochastic Pension Funding : Proportional Control and Bilinear Processes*», *Astin Bulletin*, Vol. 29, No. 2, 1999.
- BÉDARD, Diane and Daniel DUFRESNE : «*Pension Funding and Moving Average Rates of Return*», *Scandinavian Actuarial Journal*, à paraître dans le Volume 2000, No. 2, 2000.
- COSSETTE, Hélène and Étienne MARCEAU : «*The Discrete-Time Risk Model with Correlated Classes of Business*», *Insurance : Mathematics and Economics* (26) 2-3, pp. 133-149.
- COSSETTE, Hélène, Michel DENUIT and Étienne MARCEAU : «*Impact of Dependence Among Multiple Claims in Single Loss*», *Insurance : Mathematics and Economics* (26) 2-3, pp. 213-222.
- GENDRON, Michel et Étienne MARCEAU : «*L'accès à l'assurance habitation dans les quartiers centraux de quatre villes québécoises*», *Assurances*, Vol. 67, No. 3, octobre 1999, pp. 479-494.
- GENEST, Christian and Michel GENDRON : «*Risk Diversification Through Expert Use*», *Advances in Investment Analysis and Portfolio Management*, Vol. 7, January 2000, pp. 117-130.
- LAI, Van Son and M.-T. YU : «*An Accurate Analysis of Vulnerable Loan Guarantees*», *Research in Finance*, Vol. 17, 1999, pp. 103-137.
- MARCEAU, Étienne, Hélène COSSETTE, Patrice GAILLARDETZ et Jacques RIOUX : «*Dependence in the Individual Risk Model*», en cours de révision dans *Insurance : Mathematics and Economics*.

Publications (2000 – 2001)

- BERNIER, Gilles *et al.* : «*En grande finale, banques contre assureurs – Bancassurances ou assurbanques? Une empoignade se prépare entre les deux derniers piliers de la finance : les banques et les compagnies d'assurance*» (entrevue réalisée par Yan Barcelo), *Commerce*, mai 2001, pp. 59, 60, 62, 64.
- BERNIER, Gilles : «*Les défis de l'assurance en ces temps de bouleversements*» (entrevue réalisée par Daniel Germain), *Affaires Plus*, Vol. 24, No. 6, Juin 2001, pp. 57-58.

BERNIER, Gilles et Maxime BABIN : «*Démutualisation des sociétés canadiennes d'assurance de personnes : une caractérisation de leurs premiers appels publics à l'épargne*», Assurances, Vol. 69, juillet 2001, pp. 229-258.

COSSETTE, Hélène, Michel DENUIT, Jan DHAENE et Étienne MARCEAU : «*Stochastic Approximations of Present Value Functions*», Mitteilungen der Schweizerischen Vereinigung der Versicherungsmathematiker, Heft 1, 2001, pp. 15-27.

COSSETTE, Hélène, Michel DENUIT et Étienne MARCEAU (2001) : «*Distributional Bounds for Functions of Dependent Risks*», à paraître dans Mitteilungen der Schweizerischen Vereinigung der Versicherungsmathematiker.

COSSETTE, Hélène, Patrice GAILLARDETZ, Étienne MARCEAU et Jacques RIOUX (2001) : «*On Two Dependent Individual Risk Models*», à paraître dans Insurance : Mathematics and Economics.

GENEST, Christian, Étienne MARCEAU et M'hamed MESFIOUI (2001) : «*Upper Stop-Loss Bounds for Sums of Possibly Dependent Risks with Given Means and Variances*», à paraître dans Statistic and Probability Letters.

GENEST, Christian, Étienne MARCEAU et M'hamed MESFIOUI : «*Compound Poisson Approximations for Individual Models with Dependent Risks*», en cours de révision dans Insurance : Mathematics and Economics.

LUONG, Andrew et Louis G. DORAY : «*General Quadratic Distance Methods for Discrete Parametric Family*», à paraître dans Insurance : Mathematics and Economics.

Essais-stage terminé (Stage à L'Industrielle–Alliance)

- Geneviève CAMIRÉ
«*Couverture des garanties de placement des fonds distincts à l'aide de contrats à terme boursiers*»
Directeur : Patrick Savaria
Lecteur : Michel Gendron
Novembre 2000.

Essais de maîtrise terminés

- Najah Ben Ali ATTIG
«*Le risque de crédit : une modélisation du spread de crédit*»

Directeur : Van Son Lai
Lecteur : Michel Gendron
Juillet 1999.

- Maxime BABIN
«Démutualisation des compagnies d'assurance-vie canadiennes : aspects techniques et caractérisation des premiers appels publics à l'épargne»
Directeur : Gilles Bernier
Lecteur : Denis Moffet
Octobre 2001.
- Valérie CASTAIGNE
«Étude de la valeur à risque et du cas de Riskmetrics»
Directeur : Van Son Lai
Lecteur : Michel Gendron
Janvier 2000.
- Clémence DACHICOURT
«Diversification internationale et performances des OPCVM actions en Europe»
Directeur : Gilles Bernier
Lecteur : Jacques Saint-Pierre
Avril 2000.
- Karim DRIRA
«Les stratégies d'assurance du risque de crédit par les banques»
Directeur : Van Son Lai
Lecteur : Michel Gendron
Automne 1999.
- André GRONDIN
«Le classement des fonds d'investissement selon la performance : une application de l'approche de Vos»
Directeur : Gilles Bernier
Lecteur : Komlan Sedzro
Novembre 1999.
- Amadou Lamine SOW
«Stratégie de pénétration du marché des assurances de personnes en Chine : le cas de la société financière Sun Life (sujet à une entente de confidentialité)»
Directeur : Gilles Bernier
Lecteur : Dikran Ohannessian
Octobre 2001.

Mémoires de maîtrise terminés

- Dominique CLAVEAU
«Les mesures de risque d'un portefeuille de titres à revenus fixes et les facteurs de risque de la dette du Québec»
Directeur : Michel Gendron
Lecteurs : Van Son Lai, Jean-Marie Gagnon
Juin 1999.
- Hugo STE-MARIE
«Fusions des banques canadiennes : risque et réactions de marché»
Codirecteurs : Van Son Lai, Michel Gendron
Lecteur : Jean-Marie Gagnon
Février 2000.
- Issouf SOUMARÉ
«Le risque des portefeuilles de prêts à garanties privées avec phénomène de contagion – une application Monte-Carlo»
Directeur : Van Son Lai
Codirecteur : Michel Gendron
Décembre 1999.

Thèse de doctorat terminée

- Jean-Pierre GUEYIÉ
«Trois essais sur les banques commerciales»
Directeurs : Van Son Lai, Klaus Fischer
Mai 2000.