



DÉPARTEMENT DE FINANCE

**Journée finance mars 2007–
Semaine de la recherche**

FACULTÉ D'ADMINISTRATION
UNIVERSITÉ DE SHERBROOKE

Animation : Frank Coggins, professeur de finance

8h30 – 12h00

PRÉSENTATIONS D'ÉTUDIANTS

8h30 – 9h00

Estimation du taux de croissance des firmes

Frédéric Farrugia et Jonathan Clément, étudiants à la M.Sc. Finance

9h00 – 9h30

Prévision des matrices de variance-covariance

Guillaume Kittel-Ouimet, étudiant à la M.Sc. Finance

9h30 – 10h00

La performance des modèles de Valeur à Risque mensuelle par simulations historiques avec un filtre quotidien multivarié

Sébastien Rousseau, étudiant à la M.Sc. Finance

10h00 – 10h15

PAUSE

10h15 – 10h45

La valeur informative du bénéfice trimestriel

Joanie Dubé, étudiante à la M.Sc. Finance

10h45 – 11h15

La rémunération des dirigeants d'entreprises et la performance des firmes québécoises

Julie Bourgon, étudiante à la M.Sc. Finance

11h15 – 11h45

Analyse de la performance après regroupement

Sami A. Rabevohitra, étudiant à la M.Sc. Finance

12h00 – 13h30

DÎNER-CONFÉRENCE

La recherche à la Caisse de dépôt et placement du Québec

Patrick Savaria, Caisse de dépôt et placement du Québec

An Iterative Estimation Method of Global, Country and Sector Effects

Cécile Le Moigne, Caisse de dépôt et placement du Québec

Jean-François L'Her, Caisse de dépôt et placement du Québec

Patrick Savaria, Caisse de dépôt et placement du Québec

LUNDI – 19 MARS 2007 (suite)

13h30 – 14h00

PRÉSENTATIONS DES GROUPES DE RECHERCHE AU DÉPARTEMENT DE FINANCE

13h30 – 13h40

Jacques Préfontaine, Chaire en développement durable

13h40 – 13h50

Jean Desrochers, Groupe de recherche en capital de risque

13h50 – 14h00

Frank Coggins, Équipe de recherche sur la valeur ajoutée en gestion de portefeuille

14h00 – 17h15

RECHERCHES DES PROFESSEURS

14h00 – 14h30

Portfolio Performance Measurement: A No Arbitrage Bounds Approach

Dong-Hyun Ahn, Seoul National University

H. Henry Cao, Cheung Kong Graduate School of Business

Stéphane Chrétien, Université Laval

14h30 – 15h00

Mesures de performance des fonds locaux de développement

Jean Desrochers, Université de Sherbrooke

Jacques Préfontaine, Université de Sherbrooke

15h00 – 15h30

L'efficacité informationnelle : divulgation financière, transparence et discipline de marché

Jean Desrochers, Université de Sherbrooke

Jacques Préfontaine, Université de Sherbrooke

15h30 – 15h45

PAUSE

15h45 – 16h15

Les copules algébriques

Pierre Bouvier, Université de Sherbrooke

16h15 – 16h45

La performance et le conservatisme des modèles de la Valeur à risque mensuelle

Stéphane Chrétien, Université Laval

Frank Coggins, Université de Sherbrooke

Paul Gallant, Hydro-Québec