

FRANK COGGINS
Professeur titulaire de finance
Faculté d'administration
Université de Sherbrooke
2500 boul. de l'Université
Sherbrooke Qc, J1K 2R1 CANADA
(819) 821-8000 poste : 65156
Frank.Coggins@USherbrooke.ca

FORMATION ACADÉMIQUE

2004	DOCTORAT EN SCIENCES DE L'ADMINISTRATION (Ph. D. FINANCE) UNIVERSITÉ LAVAL, Québec, Canada
1997	PROGRAMME D'ÉCHANGE À LA MAÎTRISE EN FINANCE UNIVERSITY OF MASSACHUSETTS AT AMHERST, États-Unis
1997	MAÎTRISE EN SCIENCES DE L'ADMINISTRATION (M.Sc. FINANCE) UNIVERSITÉ LAVAL, Québec, Canada
1995	CERTIFICAT EN ANALYSE FINANCIÈRE UNIVERSITÉ DU QUÉBEC À MONTRÉAL, Canada
1994	BACCALURÉAT EN SCIENCES DE L'ADMINISTRATION (B.A.A. GESTION INTERNATIONALE) UNIVERSITÉ DU QUÉBEC À MONTRÉAL, Canada

EXPÉRIENCES ACADÉMIQUES ET PROFESSIONNELLES

Depuis 2016	TITULAIRE DE LA CHAIRE DESJARDINS EN FINANCE RESPONSABLE, Université de Sherbrooke
Depuis 2014	PROFESSEUR TITULAIRE, département de finance Université de Sherbrooke, Sherbrooke, Canada
Depuis 2012	COLLABORATEUR avec la Caisse de Dépôt et Placement du Québec sur des projets de recherche en finance responsable
Depuis 2011	INITIATEUR et RESPONSABLE de la <i>Simulation Objectif Wall Street</i> (http://ows.usherbrooke.ca/)
Depuis 2010	RESPONSABLE du voyage d'études EuroFinance (https://www.facebook.com/pages/Euro-Finance-Universit%C3%A9-de-Sherbrooke/200372090019816?ref=br_rs)
Depuis 2009	DIRECTEUR du Groupe de Recherche en Finance Appliquée (GREFA) sur la finance responsable, Université de Sherbrooke, Sherbrooke, Canada
2013	PROFESSEUR INVITÉ À L'UNIVERSITÉ LAVAL, Québec, Canada (mai à septembre 2013)
2013	PROFESSEUR INVITÉ À PARIS 1 PANTHÉON-SORBONNE, Paris, France (février à avril 2013)
2009-2014	PROFESSEUR AGRÉGÉ, département de finance Université de Sherbrooke, Sherbrooke, Canada
2004-2009	CONSULTANT EXTERNE en évaluation et gestion de risque Hydro-Québec, Montréal, Canada
2004-2009	PROFESSEUR ADJOINT, département de finance Université de Sherbrooke, Sherbrooke, Canada
2004-2005	PROFESSEUR SUPPLÉANT, département de finance Université de Sherbrooke, Sherbrooke, Canada
1998-2004	CONSEILLER EN INGÉNIERIE FINANCIÈRE Ministère des Finances du Québec, Québec, Canada

INTÉRÊTS DE RECHERCHE

Évaluation de la performance des fonds commun de placement
 Finance Responsable
 Gestion responsable des portefeuilles et des risques
 Évaluation et gestion des risques financiers
 Évaluation de la Valeur à Risque
 Modélisations GARCH des seconds moments des rendements des titres financiers

PUBLICATIONS OU ARTICLES ACCEPTÉS POUR PUBLICATION

- 2016 « The Performance of Market Timing Measures in a Simulated Environment », *Review of Finance* 20, 1153-1187.
 (avec Stéphane Chrétien, ULaval, et Félix D'Amours, Valeurs Mobilières Desjardins)
- 2015 « Effects of pension fund freezing on firm performance and risk », *Canadian Journal of Administrative Sciences*, à paraître.
 Disponible en ligne : <http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1002/cjas.1338/pdf>
 (avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2015 « Les effets du gel d'une caisse de retraite sur la performance et le risque des actions de l'entreprise », *Revue canadienne des sciences de l'administration*,
 Disponible en ligne : <http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1002/cjas.1339/pdf>
 (avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
 Traduction de l'article publié dans la version papier de la revue.
- 2015 « Should Investors Pay Attention to Domestic and US Election Regimes? A Canadian Perspective », *International Journal of Economics and Finance* 7, 105-121.
 (avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2012 « Common Information Asymmetry Factors in Syndicated Loan Structures », *Journal of Banking and Finance* 36, 1437-1451.
 (avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 2012 « Cost of Equity for Energy Utilities : Beyond the CAPM », *Energy Studies Review* 18, 17-41.
 (avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2012 « The Impact of Pension Fund Freezes on Firms' Systematic and Specific Risk », *Global Review of Accounting and Finance* 3, 43-52.
 (avec Claudia Champagne, USherbrooke, et Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2011 « Information asymmetry in syndicated loans : the cost of the distribution method », *International Proceedings of Economic Development and Research* 11, 201-206.
 (avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 2011 « La gestion des caisses de retraite : des pistes de solution pour contrer les pratiques moralement douteuses ou illégales », publié dans un collectif intitulé « La criminalité financière; Prévention, gouvernance et influences culturelles », éditions de boeck, 163-177.
 (avec Claudia Champagne et Marc-André Lapointe, USherbrooke)
- 2010 « Performance and Conservatism of Monthly FHS VaR: An International Investigation », *International Review of Financial Analysis* 19, 323-333.
 (avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2010 « Performance of Multivariate Filtered Historical Simulation Value at Risk », *Journal of Risk Management in Financial Institutions* 3, 259-277.
 (avec Stéphane Chrétien, ULaval, et Yves Trudel, USherbrooke)

- 2010 « Ensuring the Ongoing Strength of Canada's Retirement Income System through Sound Governance and Risk Management: A Principles-Based Approach »
(avec Claudia Champagne et Marc-André Lapointe, USherbrooke)
Mémoire rendu public dans le cadre d'une consultation pour le Ministère des Finances du Canada pour « Maintenir la solidité du système de revenu de retraite du Canada ».
- 2009 « Mutual Fund Daily Conditional Performance Evaluation », *Journal of Financial Research* 32, 95–122.
(Avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 2009 « Election Outcomes and Financial Market Returns in Canada », *North American Journal of Economics and Finance* 20, 1-23.
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2008 « La performance et le conservatisme des modèles VaR mensuelle », *Assurances et Gestion des Risques* 76, 169-202.
(Avec Stéphane Chrétien, ULaval et Paul Gallant, Hydro-Québec)

CAHIERS DE RECHERCHE OU AUTRES RECHERCHES NON PUBLIÉES

- 2014 « Réactions des marchés financiers aux variations de la performance extra-financière des firmes », cahier de recherche du GReFA 001-14, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, Amos Sodajahin, USherbrooke, et Rolland Gillet, Université Paris 1 – Panthéon- Sorbonne)
- 2013 « Financial market reactions to variations in social corporate performance », cahier de recherche du GReFA 001-13, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, Amos Sodajahin, USherbrooke, et Rolland Gillet, Université Paris 1 – Panthéon- Sorbonne)
- 2012 « Club deals vs syndications: the cost of the distribution method », cahier de recherche du GReFA 004-12, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 2012 « Effets du gel d'une caisse de retraite sur la performance et le risque de l'entreprise », cahier de recherche du GReFA 003-12, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval, et Magali Point, USherbrooke)
- 2012 « Consultation AMF sur l'indemnisation de consommateurs de produits et services financiers », cahier de recherche du GReFA 002-12, Université de Sherbrooke.
(avec Guy Bellemare, Claudia Champagne, Jean Desrochers, Jacques Préfontaine et Yves Trudel, USherbrooke)
- 2012 « Canadian Investment Opportunities and Electoral Regimes », cahier de recherche du GReFA 001-12, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2010 « Information Asymmetry in Syndicated Loans: the Cost of the Distribution Method », cahier de recherche du GReFA 001-10, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 2010 « Vers une gestion de risque plus efficace de la VaR : la VaR conditionnelle et sa tendance à long terme », cahier de recherche du GReFA 002-10, Université de Sherbrooke.
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, et Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2009 « Cost of Equity for Energy Utilities : Beyond the CAPM », cahier de recherche du GReFA 001-09, Université de Sherbrooke.
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2009 « Performance of Multivariate FHS Value at Risk », cahier de recherche du GReFA 002-09, Université de Sherbrooke (version antérieure à la publication dans le JRMFI).
(avec Stéphane Chrétien, ULaval, et Yves Trudel, USherbrooke)

- 2009 « Performance and Conservatism of Monthly FHS VaR: An International Investigation », cahier de recherche du GReFA 004-09, Université de Sherbrooke.
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2009 « Incidence des mesures de risque conditionnelles et quotidiennes sur la performance des fonds communs d'obligations », cahier de recherche du GReFA 003-09, Université de Sherbrooke.
(Avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval).
- 2009 « La performance des modèles de Valeur à Risque mensuelle par simulations historiques avec un filtre quotidien désagrégé »
Actes du congrès de l'ASAC 2007
(Avec Sébastien Rousseau, étudiant de maîtrise USherbrooke)
- 2004 « Évaluation de la performance des fonds communs de placement lorsque les mesures de risque sont conditionnelles à l'information publique »
Thèse de doctorat. Université Laval
- 2004 « Évaluation de la performance de fonds mutuels d'obligations : Incidence des mesures de risque conditionnelles sur leur évaluation et leur classement »
Actes du congrès de l'ASAC 2004
(Avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 2003 « Évaluation de la performance des fonds mutuels lorsque les mesures de risque sont estimées avec une paramétrisation GARCH »
Collection feuille d'argent, ministère des Finances du Québec. ISBN 2-55041620-1
- 2003 « Une analyse comparative de l'évaluation et de la précision de différentes mesures de la Valeur à Risque (VaR) pour un portefeuille de dette »
Document de travail du ministère des Finances du Québec
- 2003 « Décomposition de la Valeur à Risque (VaR) estimée par simulations historiques pour un portefeuille d'obligations »
Document de travail du ministère des Finances du Québec
- 2002 « Décomposition des mesures de performance d'un portefeuille de dette en facteurs de risque »
Document de travail du ministère des Finances du Québec
- 1998 « La réserve impartageable : origine, évolution, situation actuelle »
(Avec Jean-Pierre Girard, Université du Québec à Montréal, Michel Clément et Michel Cournoyer de la Direction des coopératives du Gouvernement du Québec.
Cahier de recherche 096, Chaire de coopération Guy-Bernier (UQAM)
<http://www.chaire-ccgb.uqam.ca/fr/recherche/96.pdf>
- 1997 « L'influence de la rémunération variable sur la performance des entreprises au Canada »
Mémoire de maîtrise, Université Laval

COMMUNICATIONS, RECHERCHES PRÉSENTÉES À DES CONFÉRENCES, ACTES DE CONGRÈS
--

- 07/2016 WORLD FINANCE CONFERENCE (WFC 2016), New York, États-Unis
« The Informational Content of the Loan Markets, an equity portfolio-based approach »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 07/2016 14TH ANNUAL INTERNATIONAL CONFERENCE ON ACCOUNTING & FINANCE, Athènes, Grèce.
« Equity Premium Predictability: Combination Forecasts versus Multivariate Regression Predictions »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 07/2016 14TH ANNUAL INTERNATIONAL CONFERENCE ON ACCOUNTING & FINANCE, Athènes, Grèce.
« Tournament Effect for Winning and Losing Funds Analyzed with Ex Ante Risk Measures »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)

- 07/2016 14TH ANNUAL INTERNATIONAL CONFERENCE ON ACCOUNTING & FINANCE, Athènes, Grèce.
« The Informational Content of the Loan Markets, an equity portfolio-based approach »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 06/2016* 56^E CONGRÈS ANNUEL DE LA SOCIÉTÉ CANADIENNE DE SCIENCE ÉCONOMIQUE (SCSE 2016), Québec, Canada.
« L'effet tournoi des fonds perdants et des fonds gagnants analysé avec des mesures de risque Ex Ante »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 06/2016 56^E CONGRÈS ANNUEL DE LA SOCIÉTÉ CANADIENNE DE SCIENCE ÉCONOMIQUE (SCSE 2016), Québec, Canada.
« L'effet tournoi des fonds perdants et des fonds gagnants analysé avec des mesures de risque Ex Ante »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 06/2016 56^E CONGRÈS ANNUEL DE LA SOCIÉTÉ CANADIENNE DE SCIENCE ÉCONOMIQUE (SCSE 2016), Québec, Canada.
« La capacité des mécanismes de détection de la fraude à minimiser l'occurrence d'événements médiatiques néfastes: Une analyse empirique »,
(avec Line Drapeau, USherbrooke)
- 04/2016 23RD ANNUAL GLOBAL FINANCE CONFERENCE (GFC 2016), Fresno, Californie, États-Unis
« The Informational Content of the Loan Markets, an equity portfolio-based approach »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 09/2014* PRINCIPLES FOR RESPONSIBLE INVESTMENT (SECTION ORGANISÉE PAR LA CAISSE DE DÉPÔT ET PLACEMENT DU QUÉBEC), ACADEMIC CONFERENCE (PRI Academic 2014), Montréal, Canada.
« Market Reactions to Variations in Corporate Extra-Financial Performance »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Roland Gillet, Université Paris 1, Amos Sodjahin, USherbrooke)
- 05/2014 SÉMINAIRES DE RECHERCHE DE LA CAISSE DE DÉPÔT ET PLACEMENT DU QUÉBEC (CDPQ2014), Montréal, Canada.
« Market Reactions to Variations in Corporate Extra-Financial Performance »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Roland Gillet, Université Paris 1, Amos Sodjahin, USherbrooke)
- 04/2014 JOURNÉE SUR LA PÉDAGOGIE DE L'IDÉE AUX CHANGEMENTS (2014), Sherbrooke, Canada.
« La simulation d'une carrière de gestionnaire de portefeuille : la simulation *Objectif Wall Street* »,
- 03/2014 MIDWEST FINANCE ASSOCIATION CONFERENCE (MFA2014), Orlando, États-Unis.
« The Performance of Market Timing Measures in a Simulated Environment »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval, Félix d'Amours, Mouvement Desjardins)
- 09/2013 CONFÉRENCE DE LA NORTHERN FINANCE ASSOCIATION (NFA 2013), Québec, Canada.
« The Informational Content of the Syndicate Loan Markets »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 06/2013 CONFÉRENCE DE L'ASSOCIATION DES SCIENCES ADMINISTRATIVES DU CANADA (ASAC 2013), Calgary, Canada.
« Réaction des marchés financiers aux variations des performances sociales des firmes »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Roland Gillet, Université Paris 1, Amos Sodjahin, USherbrooke)
- 04/2013 * 16TH CONFERENCE OF THE SWISS SOCIETY FOR FINANCIAL MARKET RESEARCH (SGF 2013), Zurich, Suisse.
« The Performance of Market Timing Measures in a Simulated Environment »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval, Félix d'Amours, Mouvement Desjardins)

- 02/2013 * SÉMINAIRE DE RECHERCHE DU PRISM DE LA SORBONNE, Paris, France
« The Performance of Market Timing Measures in a Simulated Environment »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval, Félix d'Amours, Mouvement Desjardins)
- 06/2012 EUROPEAN FINANCIAL MANAGEMENT ASSOCIATION (EFMA 2012), Barcelone, Espagne.
« The Performance of Market Timing Measures in a Simulated Environment »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval, Félix d'Amours, Mouvement Desjardins)
- 06/2012 CONFÉRENCE DE L'ASSOCIATION DES SCIENCES ADMINISTRATIVES DU CANADA (ASAC 2012), St-John's, Canada.
« Les effets du gel des caisses de retraite sur la performance et le risque des entreprises »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 05/2012 MATHEMATICAL FINANCE DAYS - JOURNEES DE LA FINANCE MATHEMATIQUE (JFM 2012), Montréal, Canada.
« Interactions between Capital Markets: the Informational Content of the Syndicated Loan Market »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 09/2011 WORLD BUSINESS, ECONOMICS AND FINANCE CONFERENCE (WBEF 2011), Bangkok, Thaïlande.
« The impact of pension fund freezes on firms' systematic and specific risk »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Stéphane Chrétien, ULaval)
- 07/2011 ASIAN FINANCE ASSOCIATION (AsianFA2011), Macao, Chine.
« Information Variables and Market Premium Predictability in Canada »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 07/2011 INTERNATIONAL CONFERENCE ON FINANCIAL MANAGEMENT AND ECONOMICS (ICFME 2011), Hong Kong, Chine.
« Information Asymmetries in the Syndicated Loan Market: the Cost of the Distribution Method »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 07/2011 PACIFIC BASIN FINANCE, ECONOMICS, ACCOUNTING AND MANAGEMENT CONFERENCE (PBFEM 2011), Taipei, Taiwan.
« Common Information Asymmetries factors in Syndicated Loans »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 06/2011 FINANCIAL MANAGEMENT ASSOCIATION EUROPEAN CONFERENCE (European FMA 2011), Porto, Portugal.
« Common Information Asymmetries factors in Syndicated Loans »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 05/2011 MATHEMATICAL FINANCE DAYS - JOURNEES DE LA FINANCE MATHEMATIQUE (JFM 2011), Montréal, Canada.
« Information Variables and Market Premium Predictability in Canada »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 05/2011 MATHEMATICAL FINANCE DAYS - JOURNEES DE LA FINANCE MATHEMATIQUE (JFM 2011), Montréal, Canada.
« The Performance of Market Timing Measures in a Simulated Environment »,
(avec Stéphane Chrétien, ULaval, Félix D'Amours, Ph.D. ULaval)
- 09/2010 NORTHERN FINANCE ASSOCIATION (NFA 2010), Winnipeg, Canada.
« Information asymmetry in syndicated loans: the cost of the distribution method »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 06/2010 GLOBAL FINANCE CONFERENCE (GFC 2010), Poznan, Pologne.
« Performance and Conservatism of Monthly FHS VaR: An International Investigation »
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
« Best Paper Award », GFC2010.

- 06/2010 MULTINATIONAL FINANCE SOCIETY, Barcelone, Espagne.
« Information asymmetry in syndicated loans: the cost of the distribution method »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 05/2010 ASSOCIATION DES SCIENCES ADMINISTRATIVES DU CANADA (ASAC 2010), Régina, Canada.
« La performance des mesures de performance »
(avec Félix D'Amours, M.Sc. USherbrooke)
« Mention avec honneur » de la division Finance, ASAC 2010.
- 04/2009 * EUROPEAN FINANCIAL MANAGEMENT ASSOCIATION 2009 – RISK MANAGEMENT IN FINANCIAL INSTITUTIONS SYMPOSIUM, Nantes, France.
« Performance and Conservatism of Monthly FHS VaR: An International Investigation »
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 02/2009 * MIDI-RECHERCHE – GROUPE CONSEIL EN GESTION DE RISQUE AON, Montréal, Canada.
« La performance et le conservatisme des modèles VaR mensuelle »
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 02/2009 * CONFÉRENCE EN GESTION DES RISQUES FINANCIERS – HYDRO-QUÉBEC, Montréal, Canada.
« Vers une gestion de risque plus efficace : la VaR conditionnelle et sa tendance »
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 04/2008 * SEMAINE DE LA RECHERCHE 2008 – UNIVERSITÉ DE SHERBROOKE, Sherbrooke, Canada.
« Gestion de risque à deux signaux : La valeur à risque conditionnelle et sa tendance à long terme »
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 05/2007* ASSOCIATION DES SCIENCES ADMINISTRATIVES DU CANADA (LES ACTES DE L'ASAC 2007), Ottawa, Canada.
« La performance des modèles de Valeur à Risque mensuelle par simulations historiques avec un filtre quotidien désagrégé »
(Avec Sébastien Rousseau, USherbrooke)
- 03/2007 * SEMAINE DE LA RECHERCHE 2007 – UNIVERSITÉ DE SHERBROOKE, Sherbrooke, Canada.
« La performance et le conservatisme des modèles VaR mensuelle »
(avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 06/2006 * FINANCIAL MANAGEMENT ASSOCIATION EUROPE (FMAE, 2006), Stockholm, Suède.
« Mutual Fund Daily Conditional Performance Evaluation: Selectivity and Timing Measurements »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 12/2005 * AUSTRALASIAN FINANCE AND BANKING CONFERENCE (AFBC, 2005), Sydney, Australie.
« Mutual Fund Daily Conditional Performance Evaluation: Selectivity and Timing Measurements »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 09/2004 * NORTHERN FINANCE ASSOCIATION (NFA 2004), St-John's, Canada.
« Evaluation of Mutual Fund Performance When Risk Measures Are Estimated Using GARCH Parameterization »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 06/2004 * ASSOCIATION DES SCIENCES ADMINISTRATIVES DU CANADA (LES ACTES DE L'ASAC 2004), Québec, Canada.
« Évaluation de la performance de fonds mutuels d'obligations : Incidence des mesures de risque conditionnelles sur leur évaluation et leur classification »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
Prix de la meilleure recherche par un étudiant pour la division finance (ASAC 2004)
- 04/2004 * SÉMINAIRE DU DÉPARTEMENT DE FINANCE DE L'UNIVERSITÉ SHERBROOKE, Sherbrooke, Canada.
« Évaluation de la performance des fonds mutuels lorsque les mesures de risque sont conditionnelles »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)

- 06/2003 * ASSOCIATION DES SCIENCES ADMINISTRATIVES DU CANADA (LES ACTES DE L'ASAC 2003), Halifax, Canada.
« Évaluation de la performance des fonds mutuels lorsque les mesures de risque sont conditionnelles »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 11/2002 * LES CONFÉRENCES DE L'UNIVERSITÉ LAVAL ET DU MINISTÈRE DES FINANCES DU QUÉBEC, Québec, Canada.
« Décomposition des mesures de performance d'un portefeuille de dette »
- 11/2002 * LES CONFÉRENCES DE L'UNIVERSITÉ LAVAL ET DU MINISTÈRE DES FINANCES DU QUÉBEC, Québec, Canada.
« Performance de six modèles d'évaluation de la Valeur à Risque pour un portefeuille de dette »
- 10/2002 * LES SÉMINAIRES DU DÉPARTEMENT DE FINANCE ET ASSURANCE DE L'UNIVERSITÉ LAVAL, Québec, Canada.
« Évaluation de la performance des fonds mutuels lorsque les mesures de risque sont conditionnelles »
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 05/2002 * LES CONFÉRENCES DE L'ASSOCIATION CANADIENNE-FRANÇAISE POUR L'AVANCEMENT DES SCIENCES (ACFAS 2002), Québec, Canada.
« Évaluation de la performance des fonds mutuels lorsque les mesures de risque sont conditionnelles »
(version préliminaire)
(avec Marie-Claude Beaulieu et Michel Gendron, ULaval)
- 05/1998 * LES CONFÉRENCES DE L'ASSOCIATION CANADIENNE-FRANÇAISE POUR L'AVANCEMENT DES SCIENCES (ACFAS 1998), Québec, Canada.
« La réserve impartageable des coopératives: origine, évolution et situation actuelle »

* Indique que j'ai moi-même présenté la recherche, sinon le conférencier est l'un des co-auteurs.

RECHERCHES EN COURS

- 2015 « Financial Market Reactions to Variations in Corporate Social Performance »,
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, Roland Gillet, Université Paris 1, Amos Sodjahn, USherbrooke), en évaluation.
- 2015 « Interactions between Capital Markets: the Informational Content of the Syndicated Loan Market »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, et Stéphane Chrétien, ULaval), à soumettre.
- 2014 « Risk Management with Conditional VaR : A Two-Signal Approach »
(avec Claudia Champagne, USherbrooke, et Stéphane Chrétien, ULaval), à soumettre.

PRIX, SUBVENTIONS, FINANCEMENTS ET BOURSES D'EXCELLENCE

- 2016-2021 Chaire Desjardins en finance responsable (1 430 000 \$) – Titulaire
(Avec Claudia Champagne, chercheuse principale, USherbrooke)
- 2016-2022 Groupe de Recherche en finance responsable GReFA (150 000 \$) – Chercheur responsable
(avec Marie-Pierre Allard, Alain Bélanger, Claudia Champagne, Jean Desrochers, Michel Dion, Anasthassios Gentzoglani, Marc-André Lapointe, Lyne Latulippe, Claude Mathieu, Karine Pelletier, Hyacinthe Somé et Yves Trudel, USherbrooke)
- 2015-2017 Subvention du Fonds d'innovation pédagogique (FIP) pour le projet « Simulation OWS » (30 000\$)
- 2012-2015 Subvention d'équipe de recherche (Groupe de Recherche en Finance Appliquée) par l'Université de Sherbrooke via son concours PIFIR (132 000 \$) – chercheur principal
(avec Alain Bélanger, Guy Bellemare, Claudia Champagne, Jean Desrochers, Anasthassios Gentzoglani, Marc-André Lapointe, Jacques Préfontaine et Yves Trudel, USherbrooke)

- 2012-2015 Subvention de l'Autorité des marchés financiers (Fonds pour l'éducation et la saine gouvernance) pour le projet de simulation Objectif Wall Street (265 000\$) – Simulation sur l'investissement responsable
- 2011-2013 Subvention du Programme d'innovation en formation pour le projet « Simulation de gestionnaires de portefeuille dans un environnement web » (40 000\$)
- 2011 « Excellent Paper Award » à l'INTERNATIONAL CONFERENCE ON FINANCIAL MANAGEMENT AND ECONOMICS (ICFME 2011), Hong Kong, Chine.
« Information Asymmetries in the Syndicated Loan Market: the Cost of the Distribution Method », (avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 2011 Subvention du Fonds d'appui à la pédagogie universitaire (FAPU) pour le projet « Simulation des gestionnaires de portefeuille dans un environnement web » (7 000\$)
- 2011 « Mention honorable » décernée par la *CFA-Toronto society* pour la recherche intitulée « Information Variables and Market Premium Predictability in Canada » (avec Stéphane Chrétien, ULaval).
- 2010 Responsable de l'axe financier de la Chaire en intégrité financière CIBC
- 2010 « *Best Paper Award* » à la GLOBAL FINANCE CONFERENCE (GFC 2010)
« Performance and Conservatism of Monthly FHS VaR: An International Investigation » (avec Stéphane Chrétien, ULaval)
- 2010 « Mention honorable » à la division finance de L'ASSOCIATION DES SCIENCES DE L'ADMINISTRATION DU CANADA (ASAC2010)
« La performance des mesures de performance » (avec Félix D'Amours, USherbrooke)
- 2009-2012 Subvention universitaire et facultaire au Groupe de Recherche en Finance Appliquée - GReFA (55 000 \$) – chercheur principal (avec Guy Bellemare, Claudia Champagne, Jean Desrochers, Marc-André Lapointe, Jacques Préfontaine et Yves Trudel, USherbrooke)
- 2008-2011 Subvention aux Jeunes Chercheurs de l'Institut de Finance Mathématique de Montréal (IFM2) (50 500 \$) (Avec Claudia Champagne, USherbrooke)
- 2006-2009 Subvention facultaire à l'équipe de recherche sur la valeur ajoutée en gestion de portefeuille (30 000 \$) (avec Guy Bellemare et Yves Trudel, USherbrooke)
- 2006 Cinquième meilleure évaluation d'enseignement parmi les professeurs de la Faculté d'administration de l'Université de Sherbrooke à la session d'automne 2006.
- 2005 Subvention pour l'acquisition de banques de données de l'Institut de Finance Mathématique de Montréal (IFM2) (12 000 \$)
- 2005 Subvention de démarrage de l'Université de Sherbrooke (15 000 \$)
- 2004-2005 Tableau d'honneur de la faculté des sciences de l'administration de l'Université Laval
- 2004 « Prix de la meilleure recherche » par un étudiant pour la division finance de L'ASSOCIATION DES SCIENCES DE L'ADMINISTRATION DU CANADA (ASAC 2004)
« Évaluation de la performance de fonds mutuels d'obligations : Incidence des mesures de risque conditionnelles sur leur évaluation et leur classification »
- 2000-2003 Bourse de doctorat du programme de recherches de l'Université Laval (IFM2) portant sur la gestion d'un portefeuille de dette publique (30 000 \$)
- 2003 Bourse Carmand Normand (2 000 \$) pour la présentation à l'ASAC de la recherche intitulée « Évaluation de la performance des fonds mutuels lorsque les mesures de risque sont conditionnelles »
- 2001 Bourse de doctorat de la Chaire en assurance l'Industrielle-Alliance (4 500 \$)

1998-2000	Bourse d'excellence de doctorat du fonds pour la formation de chercheurs et l'aide à la recherche (FCAR) (39 000 \$)
1998	Bourse d'excellence en recherches de la Fondation du Prêt d'honneur pour l'essai de maîtrise (3 000 \$)
1996	Bourse d'excellence de la Fondation Pierre Côté pour encourager un étudiant à la maîtrise à parfaire sa formation à l'étranger (4 500 \$)
1994	Bourse d'excellence de la Fondation UQAM pour souligner l'excellence académique et l'implication sociale (1 000 \$)
1993	Prix d'excellence de la Fondation Desjardins pour le Projet d'études internationales: Les coopératives d'Europe (1 000 \$)

DIRECTION OU CO-DIRECTION D'ÉTUDIANTS EN RECHERCHE

Doctorat : Prénom, Nom (année de diplomation, le cas échéant)
Moussa Fall.

Maîtrise : Prénom, nom (année de diplomation, le cas échéant)
Philippe-Olivier Blanchet (2016), Maxime Lemay-Crilly (2015), Maxime Brisebois-Lemelin (2015), Édith Breault (2015), Marie Gravel (2015), Line Drapeau (2015), Guillaume Lamoureux-Bélair (2014), Maxime Dépôt (2012), David Lamoureux (2012), Stéphanie Buote (2012), Dany Bernier (2011), Philippe Germain-Gauvin (2011), Marc-André Coulombe (2011), Magali Point (2011), Félix D'Amours (2010), Philippe Ingham (2010), Amélie Desroches (2009), Kevin Maurice (2009), Steven St-Pierre (2009), Issam Azizi (2009), Matteo Seregini (2009), Alexis Morin (2008), Sébastien Rousseau (2007), Julie Bourgon (2007), Josée Vaillancourt (2006), Alexandre Fortier (2006), Marie-Pierre Schryer-Ramsay (2005), Nicolas Chauvette, Simon Mathieu, Thi Ngoc Tuyen Tran, Michel Léveillé, Samuel Chrétien, Maxime Brochu, Laurent Coche, Steve Gagné, François Parenteau, Guy Lavallée, Katrine De Grandpré-Leclerc, Gabriel Maheux.

Lecteur : Nokan Konan Hagouagn'rin, Jocelyn Grira, Vincent Glode, Jasmin Villeneuve, Philippe Ostiguy.

ÉVALUATEUR POUR DES ORGANISMES SUBVENTONNAIRES

Depuis 2013	Comité d'évaluation des demandes de subvention FQRSC
Depuis 2011	Expert international en évaluation de demandes de subvention du FRS-FNRS - Belgique
2008-2012	Comité d'évaluation des demandes de bourses de l'Institut de Finance Mathématique de Montréal (IFM2)

ÉVALUATEURS POUR DES REVUES SCIENTIFIQUES ET DES CONGRÈS SCIENTIFIQUES

2016	<i>North American Finance Conference</i>
2016	<i>North American Journal of Economics and Finance</i>
2015	<i>Actualité économique</i>
2013	<i>Empirical Economics</i>
2013	Congrès de l'Association francophone pour le savoir (ACFAS 2013), Québec, Canada
2012	Congrès de l'Association francophone pour le savoir (ACFAS 2012), Sherbrooke, Canada
2010	<i>Journal of Risk Management in Financial Institutions</i>
2008	<i>Management Research News</i>

2007 *Revue Canadienne des Sciences de l'Administration*
 2006 *Revue Canadienne des Sciences de l'Administration*
 2005 *Revue Canadienne des Sciences de l'Administration*

ORGANISATEUR, COMMENTATEUR ET RESPONSABLE DE SÉANCE LORS DE CONGRÈS

Organisateur : Journée Finance lors de la semaine de la recherche de l'Université de Sherbrooke 2006, 2007 et 2008.

Commentateur : Congrès de la SWISS SOCIETY FOR FINANCIAL MARKET RESEARCH (SGF 2013), Congrès de la European Finance Association 2009 (Risk Management in Financial Institutions Symposium, EFMA 2009), Financial Management Association Européenne (FMAE 2006), de la Northern Finance Association (NFA 2005), de l'Association des Sciences Administratives du Canada (ASAC 2004 et 2003)

Directeur de séances : Congrès de l'association canadienne de science économique (SCSE 2016), Congrès de l'Association des Sciences Administratives du Canada (ASAC 2004)

ASSOCIATION À DES CENTRES ET À DES ÉQUIPES DE RECHERCHE

Depuis 2009 Directeur du Groupe de Recherche en Finance Appliquée (GReFA) sur la finance responsable, Université de Sherbrooke
 (Avec Alain Bélanger, Guy Bellemare, Claudia Champagne, Stéphane Chrétien (ULaval), Jean Desrochers, Michel Dion, Anastassios Gentzoglani, Marc-André Lapointe, Mario Lavallée, Claude Mathieu, Jacques Préfontaine et Yves Trudel)

Depuis 2010 Responsable de l'axe financier de la Chaire de recherche en intégrité financière CIBC

Depuis 2005 Chercheur associé au Centre Interuniversitaire sur le Risque, les Politiques Économiques et l'Emploi (CIRPÉE)

2006-2009 Chercheur membre du Groupe de recherche sur la valeur ajoutée en gestion de portefeuille, Université de Sherbrooke
 (Avec Guy Bellemare et Yves Trudel, USherbrooke)

AUTRES RESPONSABILITÉS

Depuis 2015 Évaluation de demandes de subvention Mitacs

Depuis 2012 Comité de recrutement du Département de finance

Depuis 2011 Évaluation de demandes de subvention du FRS-FNRS - Belgique

Depuis 2010 Responsable du cours « Gestion des Institutions financières II » [FEC566] impliquant des visites d'institutions financières en Europe [Belgique, France, Luxembourg et Suisse]

Depuis 2009 Comité d'évaluation des demandes au fonds 20.17 (Université de Sherbrooke)

Depuis 2005 Responsable des cours de deuxième cycle « Suivi des positions et des risques des marchés » [FEC777] et « Fondements théoriques de la finance » [FEC810], Université de Sherbrooke

2005-2014 Comité de la recherche de la faculté d'administration de l'Université de Sherbrooke

2005-2014 Comité d'éducation continue de la faculté d'administration de l'Université de Sherbrooke

Hiver 2011 Évaluation d'une demande de subvention SSHRC-CRSH

2004-2009 Organisation de la semaine de la recherche de l'Université de Sherbrooke – division finance

2005-2009 Responsable du microprogramme de deuxième cycle en finance de marché de l'Université de Sherbrooke

PRÉSENCES MÉDIATIQUES

Référence à l'une de mes recherches dans les médias

2007 *Finance et Investissement*, « Mutual Fund Daily Conditional Performance Evaluation: Selectivity and Timing Measurements », 13 novembre 2007.

Mes interventions médiatiques

2015 *Journal Les Affaires*, « Un jeu qui dit si vous pouvez travailler à Wall Street », 17 février 2015
<https://www.lesaffaires.com/blogues/diane-berard/un-jeu-qui-dit-si-vous-pourriez-travailler-a-wall-street/576333>

2015 *Radio-Canada - Le téléjournal de l'Estrie – Télé*, « La simulation boursière Objectif Wall Street », 15 février 2015

2015 *Le Journal de Montréal*, « Pouvez-vous atteindre Wall Street », 12 février 2015
<http://www.journaldemontreal.com/2015/02/12/pouvez-vous-atteindre-wall-street>

2015 *Radio-Canada - Écoutez l'Estrie – Radio*, « La simulation boursière Objectif Wall Street », 12 février 2015
http://ici.radio-canada.ca/emissions/ecoutez_1_estrie/2014-2015/archives.asp?date=2015/02/12&indTime=2538&idmedia=7243283

2013 *Le Devoir*, « Facteurs ESG - La Caisse de dépôt et placement poursuit son virage responsable », 12 octobre 2013 (journaliste : Vicky Fragasso-Marquis)

2012 *Entrevue avec Réjean Blais, Estrie-Express*, « Faut-il suivre la Caisse de Dépôt », 7 juin 2012.

2011 *La Presse Affaires*, « Les marchés boursiers : Aubaines ou attrapes ? », 30 septembre 2011 (journaliste : André Dubuc).