

# **Défis actuels de la finance : Nouvelles approches théoriques et Gestion des risques bancaires et financiers**

**12-13 Novembre 2009**

**CEPN, LAGA Université Paris 13**

**12/11/2009**

**09H00 Accueil**

**09H30 Allocutions**

**Charles Desfrancois, Vice-Président du Conseil Scientifique de l'Université Paris 13**

**Donatella Gatti, Directrice du CEPN**

**Laurence Halpern, Directrice du LAGA**

**10H00-11H00 Pierre-Louis Lions (Collège de France) « On mean field games »**

**11H00-11H15 Pause Café**

**11H15-12H00 Jean-Michel Lasry (Université Paris Dauphine) « Un modèle MFG de liquidité »**

**12H00-12H45 Gabriel Turinici (Université Paris Dauphine) « Numerical approaches for mean field games problems »**

**12H45-14H00 Déjeuner**

**14H15-15H00 Olivier Guéant, (Université Paris Dauphine) « Dynamique de production d'une ressource épuisable : une approche MFG »**

**15H00-15H45 Xavier Ragot (EEP-CNRS et Banque de France) « Produits dérivés : Pourquoi les agents échangent-ils du risque ? »**

**15H45-16H15 Pause Café**

**16H15-17H00 Edouard Challe (Ecole Polytechnique) « Produce or speculate? Asset bubble, occupational choice and efficiency »**

**17H-17H45 Xavier De Scheemaekere (Solvay Brussels School of Economics and Management)  
« Dynamic risk indifference pricing in incomplete markets »**

**20H-22H Dîner de Gala : Le Procope, 13 Rue de l'Ancienne Comédie, 75006 Paris**

**13/11/2009**

**09H15-10H00 René Carmona (Princeton University) « Challenges of the Carbon Markets »**

**10H00-10H45 Philip Protter (Cornell University) « How Bubbles Can Affect Futures »**

**10H45-11H00 Pause Café**

**11H00-11H45 Albert Shiryaev (Steklov Institute, Moscou) « On the stochastic trading rules "Buy-Hold-Sell" »**

**11H45-12H30 Walter Schachermayer (Universität Wien) « The fundamental theorem of asset pricing for continuous processes under small transaction costs »**

**12H30-14H00 Déjeuner**

**14H00-14H45 Rama Cont (CNRS, Paris VI). « Risque systémique et contagion dans les réseaux bancaires »**

**14H45-15H30 Dominique Garabiol (Caisse Nationale d'Épargne) « La supervision macro prudentielle : enjeux et ambiguïtés »**

**15H30-16H15 Frank Taïeb (Quantitative risk analyst) « Modèles de risques, modèles risqués ? Quelques réflexions sur le risque de modèle »**

**16H15-16H45 Pause Café**

**16H45-17H30 Nicolas Bouleau (Ecole des Ponts ParisTech) « Réflexions sur la mathématisation des risques »**

**17H30-18H15 Table Ronde « Les leçons de la crise pour les mathématiciens et les gestionnaires de risque » sous la présidence de Dominique Plihon avec Nicolas Bouleau, Rama Cont, Dominique Garabiol et Frank Taïeb**