

**Journée « Chaire Finance & Développement Durable »
& Laboratoire de Finance des Marchés d'Énergies
EDF R&D, Calyon, Université Paris Dauphine, CREST.**

Mercredi 26 Mars 2008 , Université Paris Dauphine Salle A709

**Contact : Damien Fessler - Université Paris Dauphine – 1, place du Maréchal de Lattre de Tassigny, 75016 Paris
damien.fessler@dauphine.fr - téléphone : 01 44 05 44 53**

Le Laboratoire de Finance des Marchés d'énergies (FiME) est un projet de recherche commun entre l'Université Paris Dauphine, le Centre de Recherche en Economie et en Statistique (CREST) et la R&D du groupe EDF. Créé en même temps que la Chaire Dauphine EDF CALYON « Finance et Développement Durable – Approches Quantitatives », il a pour vocation d'accueillir des chercheurs de toutes institutions académiques désireux de travailler avec des ingénieurs-chercheurs de la R&D d'EDF sur les problématiques d'économie mathématique et de finance quantitative de long terme du secteur énergétique.

La journée du 26 Mars 08 sera l'occasion pour l'ensemble des personnes participant à ce double projet de présenter leurs travaux. L'entrée est libre. Toutefois, pour des raisons de logistique, **nous prions les personnes intéressées de bien vouloir s'inscrire auprès de Damien Fessler, secrétaire de la Chaire.**

9:00 – 9:15	Accueil des participants	R. Aïd
9:15 - 10:00	Investissement et concurrence : faut-il laisser le temps au temps ?	B. Villeneuve
10:00 – 10:45	Pipelines & contracts de long terme : au-delà de la théorie du hold-up	L. Durand-Viel & B. Villeneuve
10:45 – 11:00	Pause	
11:00 – 11:45	Risque long terme et décisions d'investissement	A. Klein & G. Chemla
11:45 – 12:15	Taux écologiques	R. Guesnerie & O. Guéant
12:15 – 12:45	Table Ronde « Synthèse Conférence FDD Décembre 07 »	J. H. Keppler, J.-M. Lasry, D. Fessler
12:45 – 14:00	Déjeuner	
14:00 – 14:45	Mesures de risque vectorielles	A. Galichon
14:45 – 15:15	Jeux à champs moyens, économie des externalités et développement durable	J.-M. Lasry & P.-L. Lions
15:15 – 15:30	Pause	
15:30 – 16:00	Jeux à champs moyens et dynamique d'isolation thermique des ménages	J.-M. Lasry & A. Lachapelle
16:00 – 16:45	Modélisation GARCH des prix spots de l'électricité	J.-M. Zakoian & N. Regnard
16:45 – 17:00	Pause	
17:00 – 17:45	Dynamique risque neutre des prix de l'électricité	L. Campi, J.-M. Marin, N. Touzi
17:45 – 18:30	Valorisation d'option hors-la-monnaie par échantillonnage d'importance	J.-M. Marin & N. Oudjane

Site du laboratoire: www.fime-lab.org - Se rendre à Dauphine : <http://www.plandaces.com/dauphine>

Les intervenants

René Aïd

Ingénieur Chercheur EDF R&D, directeur du Laboratoire FiME.

Luciano Campi

Maître de conférence en mathématiques appliquées à l'Université Paris Dauphine

Gilles Chemla

Directeur de recherche au CNRS et professeur à Imperial College (Londres).

Laure Durand-Viel

Doctorante du CREST sous la direction de Bertrand Villeneuve

Alfred Galichon

Maître de conférence à l'École Polytechnique

Olivier Guéant

Doctorant sous la direction de P.-L. Lions.

Roger Guesnerie

Professeur d'économie au Collège de France

Jan Horst Keppler

Professeur d'économie à l'Université Paris Dauphine

Alexandre Klein

Ingénieur chercheur à EDF R&D

Aimé Lachapelle

Doctorant en mathématiques appliquées à Dauphine sous la direction de Guillaume Carlier

Jean-Michel Lasry

Conseiller Scientifique auprès de la Direction de Calyon, professeur associé à l'Université Dauphine

Pierre Louis Lions

Professeur au Collège de France, responsable de la Chaire « Finance et Développement Durable : Approches Quantitatives ».

Jean-Michel Marin

Chargé de recherche à l'INRIA

Nadia Oudjane

Ingénieur Chercheur EDF R&D

Nazim Regnard

Doctorant du CREST sous la direction de Jean-Michel Zakoïan

Bertrand Villeneuve

Professeur d'économie à l'Université de Tours, chercheur associé au CREST

Jean-Michel Zakoïan

Professeur de mathématiques appliquées à l'Université de Lille, chercheur associé au CREST