

Journée de la Chaire Finance et Développement Durable et du Laboratoire de Finance des Marchés de l'Énergie

**6 décembre 2011
EDF R&D – site de Clamart**

9h Accueil

9h30 Table ronde : La Chaire FDD et le laboratoire FiME : Origines et développement d'un projet scientifique original

René Aïd, Jean-Michel Lasry, Delphine Lautier, Nizar Touzi

10h30 Pause

10h45 Bilan scientifique (1)

Méthodes mathématiques pour l'économie du risque et des externalités

Jean-Michel Lasry et René Aïd

11h45 Pause

12h Bilan scientifique (2)

Marchés de l'énergie: calcul et modélisation

Delphine Lautier et Nizar Touzi

13h Déjeuner

14h Présentation des travaux des doctorants (1)

"Stochastic target resolution of the electricity prices granularity", Adrien Nguyen Huu,

A structural-risk neutral electricity for pricing electricity derivatives, Nicolas Langrené,

Bank monitoring incentives, Dylan Possamai

Comptabilité carbone appliquée aux institutions financières : l'expérimentation de CA-CIB, Antoine Rose

16h Pause

16h15 Présentation des travaux des doctorants (2)

Utility asymptotics - Indifference pricing of hybrid claims, Ludovic Moreau,

Approximation of moving average options and valuation of oil-indexed gas supply contracts, Marie Bernhart

Mean Field Games et Problématiques de Développement Durable, Aimé Lachapelle

17h45 Fin