

4^{ème} Journée de Printemps
Chaire Finance & Développement Durable et Laboratoire FiME

Mardi 6 Avril 2010
Université Paris Dauphine, salle A709

13:45 – 14:00	Accueil des participants	
14:00 – 15:30	Jeux à champ moyen et ressources épuisables	
	Rente de Hotelling, pic de Hubert et énergies de substitution : approche par une modélisation MFG	O. Guéant
	Interactions de la dynamique de production des capacités avec la dynamique des prix anticipés : formalisation de l'équilibre récursif dans l'approche MFG	J.-M. Lasry
15:30 – 16:00	Pause	
16:00 – 18:00	Economie du gaz	
	Strategic Capacity Investment under Holdup Threats: The Role of Contract Length and Width	L. Durand-Viel & B. Villeneuve
	Valorisation d'actifs réels quand toute l'information n'est pas dans le prix spot	C. Chaton & L. Durand-Viel
	Valuation of Swing options with backward stochastic differential equations with jumps	M. Bernhart
	Gestion des contrats à long terme de gaz naturel liquéfié	F. Bonnans
18:00 – 18:15	Conclusion	J.-M. Lasry

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 Ecole Polytechnique EDF CACIB CDC « 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 6 Avril 2010 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.**

Informations pratiques :

Site du laboratoire: www.fime-lab.org – Site de la Chaire FDD : www.chairefdd.org

Se rendre à Dauphine : http://www.dauphine.fr/fileadmin/mediatheque/PDF_Formations/Plan_d_acces_Dauphine.pdf

Contact : Damien Fessler

IFD Université Paris Dauphine – Place du Maréchal de Lattre de Tassigny, 75016 Paris
damien.fessler@dauphine.fr - téléphone : 01 44 05 44 53