

## Programme – Conférence Les Nouveaux Outils du Développement Durable

### Jeudi 24 octobre

8h30 Accueil des participants

9h **Ivar Ekeland (Université Paris Dauphine) « Qu'est-ce que le développement durable »**

9h40 **Roger Guesnerie (Collège de France) « La valorisation du capital naturel »**

10h20 Pause

10h40 **Atelier « Assurance indicielle à partir d'images satellites »**

Présidé par Bruno Bouchard (Université Paris Dauphine)

- Bruno Lepoivre (Pacifica) : *Introduction de l'atelier : couverture des risques en assurance fourrage et assurance indicielle*
- Antoine Roumiguie (Doctorant au laboratoire de télédétection de Purpan): *Construction d'indices de production à partir d'images satellites et protocoles agronomiques*
- Constance Collin (Doctorante Cifre Pacifica et Université Paris-Ouest Nanterre) : *Problèmes de tarification indicielle*
- Philippe Guichandut et Thérèse Sandmark (Fondation Grameen Crédit-Agricole) : *Perspectives en micro-assurance*

12h30 déjeuner

13h30 **Conférence invitée : Alejandro Jofre (CMM, Universidad de Chile) Energy markets: pricing and regulation**

14h15 **Atelier « Méthodes numériques pour les marchés de l'énergie »**

Présidé par Emmanuel Gobet (CMAP, Ecole Polytechnique)

- Tan Xiaolu (Université Paris-Dauphine), *Approximation probabiliste numérique pour les problèmes de contrôle stochastique*
- Plamen Turkedjiev (Ecole Polytechnique), *Méthodes de régression empirique pour les équations de programmation dynamique stochastique*
- Laurent Pfeiffer (Inria-Saclay et Ecole Polytechnique), *Contrôle optimal stochastique sous contrainte en probabilité*
- Jérôme Lelong (LJK, ENSIMAG), *Calcul parallèle pour les méthodes numériques probabilistes*

16h15 Pause

16h30 **Atelier « Traitement des nouvelles données »**

Présidé par Marc Hoffmann (CEREMADE, Université Paris-Dauphine)

- Marc Hoffmann (CEREMADE, Université Paris-Dauphine), *Remarques introductives*
- Dominique Picard (LPMA, Université Paris Diderot), *Prévision de la consommation électrique et méthodes linéaires en grande dimension*

17h30 **Stéphane Villeneuve (Université de Toulouse) « Contrats dynamiques et défauts des entreprises »**

18h10 Fin de la journée

## Vendredi 25 octobre

8h30 Accueil des participants

9h **René Carmona (Princeton University) « La financiarisation des commodités »**

9h40 **Atelier « Economie du risque sur les marchés de l'énergie »**

Présidé par Delphine Lautier (Université Paris Dauphine)

- Delphine Lautier (Université Paris Dauphine): *Un modèle d'équilibre des prix des matières premières* (avec B. Villeneuve et I. Ekeland)
- René Aïd (EDF R&D) : *Un modèle d'investissement en production d'électricité* (avec N. Langrené et L. Campi)
- Philippe Février (CREST): *Les enchères sur le marché de l'électricité*

11h10 Pause

11h30 **Atelier « Jeux à champ moyen »**

Présidé par Jean-Michel Lasry (Université Paris Dauphine)

- Jean-Michel Lasry (Université Paris Dauphine), *Les modélisations MFG en économie : évolutions récentes*
- Charles-Albert Lehalle (CFM), *MFG et microstructure des marchés*
- Pierre-Noël Giraud (ENSMP), *Méthodologie MFG pour les modélisations des capacités dans l'industrie des matières premières*

13h00 Déjeuner

14h15 **Atelier « Microstructure des marchés financiers et processus de formation des prix »**

Présidé par Charles-Albert Lehalle (CFM)

- Charles-Albert Lehalle (CFM), *La microstructure des marchés en pratique, 2 exemples (monitoring en temps réel d'un grand nombre d'automates de trading; modèle MFG pour la formation des prix)*
- Gilles Pagès (LPMA, Université Pierre et Marie Curie), *Trading optimal: l'approche par les algorithmes stochastiques*
- Olivier Guéant (Université Pierre et Marie Curie), *Une solution au problème du market making*

15h45 Pause

16h00 **Pierre-Louis Lions (Collège de France) « Où en sont les Jeux à Champ Moyen ? »**

16h40 Fin de la Conférence