

## PROGRAMME

Mercredi 29 mars

matin : Le Petit Kursaal (Place Granvelle)

- 8.30-9.00 Inscription.  
9.00-9.15 Cérémonie d'ouverture.  
9.15-11.00 Thèse de Bachelier. Conférenciers: J.-M. Courtault, I. Ekeland, N. El Karoui, B. Jacquillat, J.-M. Lasry.  
11.00-11.30 Pause café.  
11.30-12.00 Ch. Walter. De la thèse de Bachelier à la gestion de portefeuilles.  
12.00-12.30 A. Le Marchand. Le jeune Louis Bachelier apprenant au Havre la gestion d'actifs.  
12.45-14.15 Vin d'honneur et inauguration de la plaque commémorative (Faculté des Lettres, 32 rue Mégevand).

Après-midi : Fort Griffon, D 10

- 15.00-15.45 F. Delbaen. Risk management, measure theory and game theory.  
15.45-16.30 M. Frittelli. Sublinear risk measures and pricing rules.  
16.30-17.00 Pause café.  
17.00-17.45 E. Jouini. Convergence of models and convergence of the arbitrage and equilibrium pricing intervals.  
18.15 -19.15 Soirée poésie animée par Jacques Moulin : Faculté de Droit, bibliothèque Proudhon.

Jeudi 30 mars

Matin : Faculté des Sciences : Amphi A (Campus la Bouloie)

- 9.15-10.00 M. Yor. Le mouvement Brownien de 1950 à nos jours.  
10.00-10.45 E. Eberlein. From Bachelier to Lévy processes.  
10.45-11.15 Pause café.  
11.15-12.00 B. Øksendal. Optimal consumption and portfolio in a Black and Scholes market driven by fractional Brownian motion.  
12.00-12.45 N. El Karoui. Gestion de portefeuille avec garantie américaine.

Après-midi : Faculté de Droit, Amphi Courbet (Campus la Bouloie)

- 15.00-15.45 M. Schweizer. On information problems in financial mathematics.  
15.45-16.30 P. Imkeller. Enlargement of filtrations and arbitrage in models with insiders.  
16.30-17.00 Pause café.  
17.00-17.45 S. Pliska. Risk sensitive fixed income management.  
17.45-18.30 A. Grorud. Probabilités risque-neutre et asymétrie de l'information.

Vendredi 31 mars

Matin : Faculté de Droit, Amphi Courbet (Campus la Bouloie)

- 9.15-10.00 A. Sulem. Optimal streams of dividends in a stochastic market with delay.  
10.00-10.45 M. Jeanblanc. Dynamique des obligations à coupons zéro avec risque de défaut.  
10.45-11.15 Pause café  
11.15-12.00 M. Musiela. Towards dynamic hedging of volatility risk.  
12.00-12.45 Poster

Après-midi Faculté de Droit, Amphi Courbet (Campus la Bouloie)

- 15.00-15.45 T. Vargiolu. A Bayesian adaptive control approach to risk management under restricted information.  
15.45-16.30 R. Cont. Random fields, stochastic PDEs and the term structure of interest rates.  
16.30-17.00 Pause café.  
17.00-17.45 Table ronde animée par Jean-Pierre Olsem.  
17.45-18.00 Cérémonie de clôture.