

Advanced technics in finance 14 mars 2017

Parcours ISF - [Ingénierie statistique et financière](#)

Parcours MASEF - [Mathématiques de l'assurance, de l'économie et de la finance](#)

Parcours MASH - [Mathématiques, apprentissage et sciences humaines](#)

Le workshop se déroulera le mardi 14 mars à 9h dans la salle A709 de l'Université Paris-Dauphine.

L'objectif de ce workshop est de faire le point sur certaines avancées techniques récentes qui sont actuellement en cours de développement dans l'industrie financière. Trois principaux thèmes seront abordés.

1. L'utilisation des données massives et certaines méthodes statistiques de prise de décisions afférentes ;
2. La modélisation des comportements collectifs par l'approche de type jeux à champs moyens, pour la gestion de portefeuille et le trading haute fréquence ;
3. Les méthodes multi-grid et de différentiation automatique pour le calcul rapide des indicateurs de risque.

Ce workshop regroupera à la fois des chercheurs académiques, des responsables de cellules de recherche de l'industrie financière, et des praticiens.

Programme

9.00 - Introduction du workshop: Bruno Bouchard, Pierre Brugière *Paris Dauphine*

9.05 - Charles-Albert Lehalle *CFM - Mean Field et interactions*

9.45 - Gilles Pagès *UPMC - Automatic Differentiation*

10.25 - Pause

10.40 - Laurent Carlier *BNP Paribas - Improving Sales for Capital Markets through Machine Learning*

11.20 - Vincent Chaillet *H20 Asset Management - Le principe d'incertitude en finance*

12.00 - Othmane Kettani *Natixis - Automatic Differentiation and Multigrid*

12.40 - Conclusion du Workshop

Intervenants

- Laurent Carlier, *Deputy Head of Research, BNP Paribas*
- Charles-Albert Lehalle, *Senior Researcher, CFM*
- Gilles Pagès, *Professor UPMC*
- Vincent Chailley, *CIO, H20 AM*
- Othmane Kettani, *Natixis*