

Horizon Maths 2013

Les mathématiques se dévoilent aux industriels

Big Data, Réduction de modèles, Marchés incomplets, Problèmes en grandes dimensions, Théorie des jeux, Apprentissage

Lundi 16 décembre

9h : Accueil

9h15-9h45 : Jean Michel Lasry (Université Paris-Dauphine) MFG et Big Data

9h45-10h15 : Marc Hoffmann (CREST) Inférence statistique à travers les échelles et processus ponctuels en grande dimension

10h15 – 10h45 : pause

10h45-11h15 : Julien Laugel (MFG Labs) La deuxième vague de problèmes BigData : quelques sujets ouverts

11h15-11h45 : Gérard Biau (LSTA) Forêts aléatoires

11h45-12h15 : Francis Bach (DI ENS) Apprentissage statistique

12h30 – 14h : déjeuner

14h-14h30 : Josselin Garnier (LPMA) Imagerie interférométrique pour des données bruitées

14h30-15h : Dominique Picard (LPMA) Prédiction de la courbe journalière d'électricité par méthodes de grandes dimensions

15h-15h30 : Rama Cont (LPMA) Modélisation des risques financiers : nouveaux défis et nouveaux horizons

15h30 – 16h : pause

16h-16h30 : Yvon Maday (LJLL) Introduction aux méthodes de réduction de modèles

16h30-17h : Anthony Patera (MIT) Data-Driven Reduced Basis Methods; Application to Acoustics

17h-17h30 : Dominique Chapelle (Inria) PODs pour l'estimation paramétrique

17h30-18h : Alain Fuser (GDF SUEZ) Some tough problems in the common life of energy businesses

18h-18h30 : Table ronde avec Alain Fuser (GDF SUEZ), Yvon Maday (LJLL) et Dominique Picard (LPMA)

Mardi 17 décembre

9h : Accueil

9h30-10h00 : Julien Salomon (CEREMADE) Introduction aux MFG

10h-10h30 : Gabriel Turinici (CEREMADE) Dynamiques de vaccination issues d'une modélisation de type « Mean Field Games »

10h30-11h : Agnès Sulem (Inria) Reflected BSDEs and robust optimal stopping for dynamic risk measures with jumps

11h-11h30 : pause

11h30-12h : Gilles Pagès (LPMA) Couverture en CVaR dans un marché incomplet en présence d'un actif sous-jacent observable

12h – 14h : déjeuner

14h-14h30 : Yannick Viossat (CEREMADE) L'évolution des dynamiques de jeux d'évolution

14h30-15h : Sylvain Sorin (IMJ) Jeux de congestion: équilibres et dynamiques

15h00-15h30 : pause

15h30-16h : Vianney Perchet (LPMA) Théorie des jeux et machine learning

16h-16h30 : Clément Ménassé (GDF SUEZ, Paris 7 LPMA) Optimal hedging in incomplete markets

16h30-17h : Table ronde avec Olivier Bardou (GDF SUEZ), Gilles Pagès (LPMA) et Yannick Viossat (CEREMADE)

Clôture des journées

GDF SUEZ



FSMP
Fondation Sciences
Mathématiques de Paris