

Journées AST&Risk à Dijon

17 et 18 Janvier 2011.

Déroulement du projet

- 5ème rencontre du projet (dont la semaine au CIRM en Avril 2010).
- Le GT SPAAF : 2 vendredis par mois à Lyon, organisé par Diana et Christophe.
- Financement d'une thèse (Elena).
- Rencontres ponctuelles entre les membres du projet.
- Invitations courtes / longues
 - **passées** : Corinna Constantinescu (6 mois à mi-temps), John Nolan (1 mois), Aliou Diop (2 semaines)
- Financement de colloques / déplacements.
- Rapport à 18 mois envoyé à l'ANR en juillet 2010 (prochain rapport : rapport final).

Déroulement du projet

- 5ème rencontre du projet (dont la semaine au CIRM en Avril 2010).
- Le GT SPAAF : 2 vendredis par mois à Lyon, organisé par Diana et Christophe.
- Financement d'une thèse (Elena).
- Rencontres ponctuelles entre les membres du projet.
- Invitations courtes / longues
 - à venir : José Léon (janvier 2011), Laurens De Haan (3 semaines fin juin - début juillet, pour le colloque EVA), Susan Pitt ?
- Financement de colloques / déplacements.
- Rapport à 18 mois envoyé à l'ANR en juillet 2010 (prochain rapport : rapport final).

La suite du projet

- Colloque EVA (Extrem Value Analysis) à Lyon du 27 juin au 1er juillet 2011.
- Prolongation de 6 mois **Fin en juin 2012** ⇒ post-doc de 6 mois à Nanterre ? + invitations ect
- Rapport final en décembre 2011 ou juin 2012 ???
- Penser à la suite du projet (une autre ANR ? un projet ERC ? ...)
- **Dernières(?)** journées du projet en 2012 ? Quand ? Où ?
OU colloque sur 2 ou 3 jours à Lyon ? (qui organise ?)
thématiques ? ...

Présentation du programme des 2 jours

Lundi 17 janvier

- Petit décalage de 15 mn ??
- 10h30 Accueil / présentation des journées
- 10h40 Frédéric Planchet (Laboratoire SAF, ISFA, université Lyon 1)
Sur quelques difficultés associées à l'utilisation de l'approche risque-neutre en assurance
- 11h20 Didier Rullière (Laboratoire SAF, ISFA, université Lyon 1)
On hyperbolic iterated distortions for the adjustment of survival functions
- 13h30: Ragnar Norberg (Laboratoire SAF)
Modeling and management of earthquake risk in insurance
- 14h10: Romain Biard (Aarhus University)
Asymptotic multivariate finite-time ruin probabilities with heavy-tailed claim amounts: Impact of dependence and optimal reserve allocation

Présentation du programme des 2 jours

Lundi 17 janvier

- 14h50: Exposé de Anne Eyraud-Loisel (Laboratoire SAF, ISFA, université Lyon 1) **ANNULÉ**
- 14h50 Pierre Ribereau (I3M, université Montpellier 2)
- 15h30 Pause
- 16h Luis Paredes (Universidad Central de Venezuela)
Duality Methods to price financial derivatives that replicate portfolios compounds of tradable and non tradable assets.
- 16h40 Hervé Cardot (IMB, université de Bourgogne)
Algorithmes rapides pour l'estimation de la médiane géométrique et la classification non-supervisée "robuste" en grande dimension.
- 17h20 Fin des exposés de la première journée
- **RDV à 19h à Gevrey-Chambertin**

Présentation des 2 journées

Mardi 18 janvier

- 10h José Leon (Universidad Central de Venezuela)
- 10h40 Stéphane Loisel (Laboratoire SAF, ISFA, université Lyon 1)
Fast remote but not extreme quantiles with multiple factors.
Applications to Solvency II and Enterprise Risk Management
- 11h20 Discussion sur la suite (et fin) du projet
- Areski Cousin (laboratoire SAF, ISFA, université Lyon 1)
Pricing and Hedging Portfolio Credit Derivatives in a Bottom-up Model with Simultaneous Defaults
- 14h10 Elena Di Bernardino (laboratoire SAF, ISFA, université Lyon 1)
Plug-in estimation of quantile curves in a non-compact setting.
- 14h50 Philippe Soulier (SEGMI, Paris X)
- 15h30 Fin des journées.

Pour lundi soir

DÉGUSTATION ET REPAS AU RESTAURANT “CHEZ GUY & FAMILY” 3 PLACE DE LA MAIRIE À GEVREY-CHAMBERTIN. DÉGUSTATION À 19H

Aller-retour assuré pour les personnes qui dorment sur Dijon.

Organisation des voitures.



MERCI À PEGGY POUR L'ORGANISATION !!