



Séminaire du Laboratoire de l'Accélérateur Linéaire

Nicole El Karoui

Professeur à Paris VI et à Polytechnique

Mardi 16 Juin 2009 à 11 :00

Les mathématiques financières dans la crise

Pourquoi parle t-on tant de mathématiques financières depuis une dizaine d'années. Essentiellement à cause du développement de ce qu'on appelle les produits dérivés, qui se sont développés de manière très importante ces dernières années. Nous nous proposons de montrer quel genre de mathématiques est en jeu dans cette activité et comment elles sont utilisées. Avec bien sur comme conséquence une discussion sur leur place dans la crise. Il ne s'agit pas d'un exposé exhaustif sur les mathématiques en finance, qui sont utilisées dans de nombreux autres domaines, mais de cette situation assez rare où le business dépend effectivement de la modélisation mathématique.

Salle 101 du LAL - Bât. 200, Orsay

Thé et café seront servis 1/4 h avant le séminaire



Responsables : S. Henrot-Versillé (versille@lal.in2p3.fr) - S. Plaszczynski (plaszczy@lal.in2p3.fr)
<http://www.lal.in2p3.fr>