14th-17th january 2020

ADVANCES in FINANCIAL MATHEMATICS

15-21 rue de l'Ecole de Médecine - Monastère des Cordeliers - Paris V

PLENARY SPEAKERS

Aurélien Alfonsi - (ENPC)
Mathias Beiglböck - (University of Vienna)
Damiano Brigo - (Imperial College London)
Patrick Cheredito- (ETH Zürich)
Christa Cuchiero - (University of Vienna)
Zorana Grbac - (Université Paris Diderot)
Cyril Grunspan- (ESILV)
Antoine Jacquier - (Imperial College London)
Idris Kharroubi - (Sorbonne université)
Steven Kou - (Boston University)
Michael Ludkovski - (University of California Santa Barbara)
Johannes Muhle-Karbe - (Imperial College London)
Huyen Pham - (Université Paris Diderot)
Mathieu Rosenbaum - (Ecole Polytechnique)

PRACTITIONER AFTERNOON on 16th January 2020

MAIN TOPICS

Market liquidity & microstructure
Risk measures
Numerical methods
Model calibration and model risk
Robustness
Credit/Default/Counterparty risk
Regulatory aspects
Non-linear valuation
Systemic risk
Game theory
Big data and smart data
Blockchain...

ORGANIZING COMMITTEE

Aurélien Alfonsi	Ecole des Ponts ParisTech
Lorenzo Bergomi	Société Générale
Nicole El Karoui	Sorbonne Université
Emmanuel Gobet	Ecole Polytechnique
Idris Kharroubi	Sorbonne Université
Benjamin Jourdain	Ecole des Ponts ParisTech
Bernard Lapeyre	Ecole des Ponts ParisTech
Gilles Pagès	Sorbonne Université
Mathieu Rosenbaum	Ecole Polytechnique
Nizar Touzi	Ecole Polytechnique

https://fin-risks2020.sciencesconf.org

Chaire Risques Financiers UNE CHAIRE DE LA FONDATION DU RISQUE
École des Ponts ParisTech
l'X ÉCOLE POLYTECHNIQUE UNIVERSITÉ PARIS-SACLAY
SORBONNE UNIVERSITÉ CRÉATEURS DE FUTURS DEPUIS 1257
SOCIETE GENERALE
INSTITUT Louis Bachelier