

EDS rétrogrades et méthodes numériques probabilistes le 19 décembre 2005 au CMI, Salle C001 Université de Provence, Marseille Château-Gombert.
--

Organisateurs:

F. Delarue (delarue@math.jussieu.fr), Université Denis Diderot,
E. Pardoux (pardoux@cmi.univ-mrs.fr) et R. Rhodes (rhodes@cmi.univ-mrs.fr),
Université de Provence.

9h30-10h00	Accueil
10h00-10h45	Denis Talay (INRIA, Sophia)
11h00-11h45	Emmanuel Gobet (INP Grenoble-ENSIMAG) <i>Empirical regression method for solving generalized BSDEs.</i>
12h00-12h45	Bruno Bouchard (Université Paris 6) <i>Discrete-time approximation of stochastic BSDEs with jumps.</i>
14h00-14h45	Michael Tretiakov (University Leicester) <i>Numerical algorithms for FBSDEs using layer methods.</i>
15h00-15h45	Stéphane Menozzi (Université Paris 7) <i>An Interpolated stochastic algorithm for quasi-linear PDEs.</i>
16h00-16h45	Nizar Touzi (ENSAE, Imperial College London) <i>Second order backward SDE's and fully nonlinear PDE's.</i>
17h30-18h30	<i>Exposés courts.</i>

- Le programme des exposés courts (3x20mn) n'est pas encore complètement finalisé. Les personnes qui souhaiteraient exposer peuvent prendre contact avec les organisateurs.
- Pour participer à cette journée l'inscription est gratuite mais **obligatoire**. L'inscription se fait par envoi d'un email à l'adresse:

edsr@cmi.univ-mrs.fr

- Plan d'accès au site du CMI à l'adresse internet:

<http://www.cmi.univ-mrs.fr/~pardoux/acces.gif>