

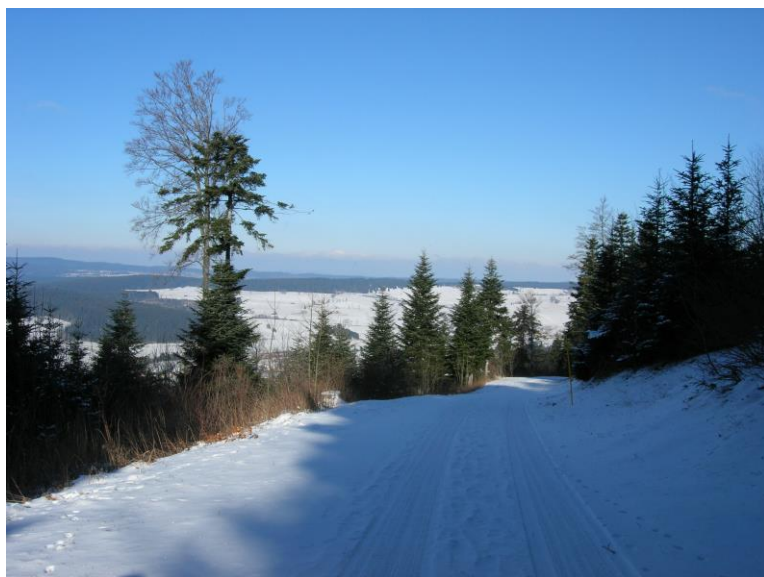


Le Colloque Bachelier à Métabief

Louis Bachelier, fondateur de la Finance Mathématique

Le 29 mars 1900, Louis Bachelier, soutient sa thèse intitulée « Théorie de la Spéculation » à la Sorbonne. Ce travail de mérite exceptionnel et fortement soutenu par Henri Poincaré, le directeur de thèse, a été publié dans les « Annales scientifiques de l'École Normale Supérieure », une des revues scientifiques françaises les plus influentes.

Cette étude pionnière sur l'analyse des marchés d'actions et d'options contient plusieurs idées phares pour la théorie financière et la théorie des probabilités. La théorie du mouvement brownien, une des découvertes mathématiques les plus importantes du 20ème siècle, a été employée pour modéliser le mouvement des prix et l'évaluation des actifs conditionnels du marché boursier. La thèse de Louis Bachelier, ainsi que ses autres travaux, a influencé profondément le développement du calcul stochastique et de la finance mathématique.



Premier colloque Bachelier : Besançon, mars 2000.

Ce colloque fut organisé à l'occasion du centenaire de la thèse de Louis Bachelier portant sur la "Théorie de la spéculation". Ce travail constitue le fondement des mathématiques financières modernes et de la théorie des processus stochastiques. Les programmes scientifiques et culturels furent hautement appréciés par les participants. En outre, ce colloque donna lieu à une série de manifestations, notamment l'inauguration d'une plaque commémorative apposée sur le mur du bâtiment où enseigna Louis Bachelier. Une rue de Besançon porte également son nom.

Deuxième colloque Bachelier : Métabief, France, janvier 2005.

Cette rencontre fut dédiée au professeur Albert Shiryaev à l'occasion de son 70ème anniversaire. Albert Shiryaev est mathématicien de tout premier plan, membre de l'Académie des Sciences de Russie. Lors de ce colloque, il donna un cours sur l'arrêt optimal.

Troisième colloque Bachelier : Métabief, France, janvier, 2008.

Les principaux sujets du colloque furent les marchés financiers avec coûts de transaction, les mesures du risque, les approches économétriques pour la fiabilité des banques.

À partir de 2010, colloque annuel.

Le colloque Bachelier est devenu la plus importante manifestation scientifique en mathématiques financières en Europe. Les fondateurs de cette événement phare de l'université de Franche-Comté sont : Jean-Michele Courtault, Youri Kabanov et Christoph Stricker.

L'organisation des colloques a été assuré par le personnel du LmB, notamment, par Catherine Pagani et Pascaline Saire. À partir du 2ème colloque, il a toujours eu lieu dans un village de vacances situé à Métabief dans le Jura. Très prisé, il réunit plus d'une centaine de participants venues du monde entier (Europe, États-Unis, Canada, Australie, Chine, Japon, Russie, ...).



Biographie de Louis Bachelier

1870 (11 mars), naissance au Havre ;
1888, Baccalauréat es sciences à Caen ;
1889 –1891, dirige l'affaire familiale ;
1891 – 1892, service militaire ;
1895, Licence es sciences à la Sorbonne ;
1897, Certificat en physique mathématique ;
1900, Thèse de doctorat ;
1909 -1914, cycle de conférences libres à la Sorbonne ;
1912, publication du livre « Calcul des Probabilités » ;
1914, publication du livre « Le Jeu, la chance et le Hasard » ;
1914 (9 septembre), appelé dans l'armée française ;
1918 (31 décembre), démobilisé de l'armée française ;
1919, Membre de la Société Mathématique de France ;
1919-1922 Chargé de cours à Besançon ;
1922-1925 Chargé de cours à Dijon ;
1925 - 1927 Maître de Conférences à Rennes ;
1927, Professeur à Besançon ;
1937, Professeur émérite ;
1941, dernière publication ;
1946 (28 avril), mort à Saint-Servan-sur-mer.

En 1996, la «Bachelier Finance Society» est fondée. En 2007 est créé le Grand prix Louis-Bachelier, prix européen de mathématiques appliquées, couronnant des contributions majeures à la modélisation mathématique en finance, et le contrôle des risques financiers.