

Philippe Briand

Professeur des universités à l'Université Savoie Mont Blanc

Philippe Briand est né en 1970. Après des études de mathématiques, il soutient une thèse de doctorat en 1997 à l'Université Blaise Pascal de Clermont-Ferrand. À l'issue d'un postdoctorat à l'université de Princeton, il est maître de conférences à l'Université Rennes 1 de septembre 1998 à août 2008. Il soutient une Habilitation à Diriger des Recherches en novembre 2007. Depuis septembre 2008, il est professeur des universités à l'Université Savoie Mont Blanc. Membre de la 26^e section du CNU de 2011 à 2015, il dirige le laboratoire de Mathématiques de l'Université Savoie Mont Blanc, UMR 5127 du CNRS, depuis mars 2014. Ses travaux de recherche se situent en mathématiques appliquées dans le domaine des probabilités. Il travaille plus particulièrement en analyse stochastique sur les équations différentielles stochastiques, les équations différentielles stochastiques rétrogrades et leurs applications aux équations aux dérivées partielles et en mathématiques financières.

Principales publications :

- Philippe Briand and Céline Labart, Simulation of BSDEs by Wiener chaos expansion, *Ann. Appl. Probab.* 24 (2014), no. 3, 1129-1171.
- Philippe Briand and Romuald Elie, *A simple constructive approach to quadratic BSDEs with or without delay*, *Stochastic Process. Appl.* 123 (2013), no. 8, 2921-2939.
- Philippe Briand and Ying Hu, *Quadratic BSDEs with convex generators and unbounded terminal conditions*, *Probab. Theory Related Fields* 141 (2008), no. 3-4, 543-567.
- Philippe Briand and Fulvia Confortola, *BSDEs with stochastic Lipschitz condition and quadratic PDEs in Hilbert spaces*, *Stochastic Process. Appl.* 118 (2008), no. 5, 818-838.
- Philippe Briand, Jean-Pierre Lepeltier, and Jaime San Martin, *One-dimensional BSDE's whose coefficient is monotonic in y and non-lipschitz in z* , *Bernoulli* 13 (2007), no. 1, 80-91.
- Philippe Briand and Ying Hu, *BSDE with quadratic growth and unbounded terminal value*, *Probab. Theory Related Fields* 136 (2006), no. 4, 604-618.
- Philippe Briand, Bernard Delyon, Ying Hu, Étienne Pardoux and Lucretiu Stoica, *L_p solutions of backward stochastic differential equations*, *Stochastic Process. Appl.* 108 (2003), no. 1, 109-129.
- Philippe Briand, Bernard Delyon, and Jean Mémin, *On the robustness of backward stochastic differential equations*, *Stochastic Process. Appl.* 97 (2002), no. 2, 229-253.
- Philippe Briand and Ying Hu, *Stability of BSDEs with random terminal time and homogenization of semilinear elliptic PDEs*, *J. Funct. Anal.* 155 (1998), no. 2, 455-494.