



## Anh Ngoc LAI

### Maitre de conférences

Mes domaines de recherche sont la Finance de marché, notamment l'allocation optimale de portefeuille, l'évaluation des produits dérivés et la gestion des risques, ainsi que la Finance quantitative, particulièrement les modèles stochastiques et les modèles économétriques appliqués à la finance.

> **Laboratoire de recherche** : CREM UMR CNRS 6211

### Thèmes de recherche

Gestion de portefeuille

Produits dérivés

Gestion des Risques

Supply chain finance

### Activités pédagogiques

#### Enseignements principaux

- Econometrics and statistics for finance, Master 2 Recherche en Finance (cours en anglais)
- Quantitative Financial and risk management, Master 2 Recherche en Finance (cours en anglais)
- Options et autres produits dérivés, Master 2 Finance analyse et stratégie financière
- Prévisions avec les séries temporelles, Master 2 Gestions des risques
- Application de l'analyse discriminante à l'analyse crédit, Master 1 Finance
- Introduction à la finance quantitative, Master 1 Finance

### Activités de recherche

#### Articles dans des revues classées

---

VIVIANI J.L., LAI A.N., LOUHICHI W. (à paraître), **The Impact of Asymmetric Ambiguity on Investment and Financing Decisions**, *Economic Modelling*, à paraître, [CNRS 2 / HCERES A]

LAI A.N., MELLIOS C. (2016), **Valuation of Commodity Derivatives with an Unobservable Convenience Yield**, *Computers and operations research*, 2016, 66 , p 402 - 414 , [CNRS 2 / HCERES A]

LAI A.N., MELLIOS C. , SIX P. (2016), **Dynamic speculation and hedging in commodity futures markets with a stochastic convenience yield**, *European Journal of Operational Research*, 2016, 250 (2) , p 493-504 , [CNRS 1 / HCERES A]

#### Ouvrages/Chapitres d'ouvrages

---

#### Communications/Colloques

---

LAI AN., PHAN DA., VO TLH., NGUYEN LA., (2018), **Sustainable coordination in a consignment channel under manufacturer-CSR and retailer-marketing efforts** , (19-23)-02-2018 : *20th International Working Seminar on Production Economics*, Innsbruck, Austria

PHAN DA, VO T.L.H., LAI A.N., **Coordinating contracts for a capital-constrained supply chain with retailer effort**, *7th IESM Conference*, Octobre 11-13, 2017, Saarbrücken, Germany

LAI A.N., NAVATTE P., VIVIANI J-L., (2017), **Controlling Information Asymmetry Precision To Extract Private Benefits**, *AFFI*, 2017, Valence, 31 mai - 2juin

LAI A.N., VIVIANI J.L NAVATTE P. (2017), **Controlling information precision to extract private benefits**, 34 th International Conference of the French Finance Association - AFFI , Juin 2017 Valence

LAI A.N. (2014), **Performance-based fees, asset allocation under loss aversion**, *Conference of the Multinational Finance Society*, Athens, Greece, décembre 2014

#### Autres productions

---

#### Direction de thèses

---

Three essays in supply chain finance

Doctorant : Dinh Anh Phan

Direction de thèse : [VO Thi Le Hoa](#), [LAI Anh Ngoc](#)