

# MASTER 2ème année MODELISATION ALEATOIRE

Planning des cours du 3ème Trimestre du 20 février au 13 avril 2012 (sauf cours ENSAE\*\*)

\*pas de cours les 1 et 2 mars 2012 (Conférence quantitative et statistique)

Lundi	Mardi	Mercredi	Jeudi	vendredi
<p><b>Réunion de présentation des cours :</b> <b>le 20 février à 8h30 Salle 1C06</b></p> <p>8h30 - 11h30, Surface de volatilité (P. Tankov) Salle 1C6 * <b>sauf 1er cours de 9h30-12h30 le 20/02</b></p>	<p>9h - 12h, Risque et dérivés de crédit (Y. Jiao) Salle 1C6</p> <p>9h30 - 12h30, Apprentissage statistique (S. Clemençon et N. Vayatis) Salle 3E91 à <b>partir du 28/02</b></p>	<p>11h - 13h, Statistique des données haute fréquence en finance (M. Hoffmann) <b>** à l'ENSAE :</b> - le 29/02 de 11h-13h + de 16h30-18h30, - les 7/03, 14/03, 28/03, 4/04, 11/04 et 25/04</p>	<p>8h30 - 10h30, Instruments financiers II (J. Guyon) Salle 1C6 * <b>sauf le 1er mars</b></p> <p>10h45 - 13h15, Filtrage en temps continu (M. Chaleyat-Maurel) Salle 1C6 * <b>sauf le 1er mars</b></p>	<p>9h -12h, Prédiction et investissements séquentiels (J.Y. Audibert) Salle 1C06 * <b>sauf le 2 mars</b></p>
<p>14h - 17h, Contrôle stochastique en finance (H. Pham) Salle 1C6 * <b>à partir du 27 février</b></p> <p>14h - 17h, Modèles et méthodes de la mécanique statistique (F. Comets, G. Giacomini) Salle 0D04</p> <p>17h30, Conférences professionnels Salle 1C6</p>	<p>14h - 17h, Trading haute fréquence et exécution optimale (O. Guéant) Salle 1C6</p> <p>14h - 16h30, Analyse des données et techniques neuronales (M. Cottrell) Salle C-20-13, ascenseurs rouges à Tolbiac</p> <p>16h30 - 18h30, TP d'Analyse de données et techniques neuronales (F. Rossi) Salle C-20-13, ascenseurs rouges à Tolbiac</p>	<p>14h -16h, Copules et applications financières (J.D. Fermanian) <b>** à l'ENSAE</b> - le vendredi 17/02 de 14h-18h - les 29/02, 7/03, 14/03, 28/03, 4/04, 11/04</p> <p>14h -16h, Estimation non paramétrique (A. Tsybakov) <b>** à l'ENSAE</b> - les 29/02, 7/03, 28/03, 4/04, 11/04 - les vendredis 13/04 et 4/05</p>	<p>14h15 - 17h15, Modèles de courbes de taux (L. Elie, P. Tankov) Salle 1C6 * <b>sauf le 1er mars</b></p> <p>14h15 - 17h15, Application de la statistique en sciences du vivant (C. Laredo) Salle 5D91 à partir du 8 mars</p> <p>17h30, Conférences professionnels Salle 1C6</p>	<p>13h - 16h, Informatique : logiciels statistiques (S. Souchet) Salle C-706 à Tolbiac (7ème étage, ascenseurs verts) * <b>sauf le 2 mars</b></p> <p>13h30 - 16h30, Équations rétrogrades et applications en finance (M.C. Quenez) Salle 1C06 * <b>sauf le 2 mars</b></p>

*Les examens auront lieu du 30 avril au 13 mai 2012*