

# MASTER 2ème année MODELISATION ALEATOIRE

Planning des cours du 3ème Trimestre du 6 février au 24 mars 2017 (sauf cours à l'ENSAE\*)

Lundi	Mardi	Mercredi	Jeudi	vendredi
<b>9h- 12h</b> , Traitement de données massives (S. Boucheron) Salle 2012	<b>9h-12h</b> , Statistiques computationnelles (P. Latouche) Salle C 12.06 à Tolbiac	Grandes déviations en finance (H. Pham) <b>* le 22/02 de 8h30-10h30 et les 8/03, 15/03, 22/03, 29/03 de 16h30-19h30 à l'ENSAE</b> <i>examen : date à préciser</i>	<b>8h30- 10h30</b> , Gestion d'actifs quantitative (B. Bruder) Salle 0011 <i>* sauf le 16/02 amphi 2 bâtiment Gouges</i>	<b>8h30-10h30</b> , Techniques de filtrage et d'analyse statistique appliquées à la finance (J. Turc et S. Ungari) Salle 2012
	<b>9h45- 12h45</b> , Grandes matrices aléatoires (S. Péché) Salle 2012			<b>10h45-13h15</b> , Marchés de l'énergie (R. Aïd & O. Féron) Salle 0011 <i>* sauf le 16/02 amphi 2 bâtiment Gouges</i>
<b>13h30- 17h30</b> , Méthodes probabilistes numériques avancées en finance (J.-F. Chassagneux) <b>* les 6/02, 13/02, 20/02 (pas de cours le 27/02) puis de 13h30-16h30 les 6/03, 13/03 et 20/03</b> Salle 1003	<b>14h- 17h, Cours + TP</b> Analyse de données et modèles de mélange (F. Rossi) Salle C-20-13 à Tolbiac ( <i>ascenseurs rouges</i> )	Copules et applications financières (J.-D. Fermanian) <b>* les 8/02, 22/2, 1/03 de 16h30-19h30, et les 8/03 et 15/03 de 14h-16h et le 22/03 de 10h-13h à l'ENSAE</b> <i>examen : date à préciser</i>	<b>14h- 17h</b> , Modèles avancés de la courbe des taux (Z. Grbac) Salle 0011 <i>* sauf le 16/02 amphi 2 bâtiment Gouges</i>	<b>13h30- 16h30</b> , Informatique : logiciels statistiques (S. Souchet) Salle C-402 à Tolbiac ( <i>4ème étage, ascenseurs verts</i> )
<b>14h- 17h</b> , Systèmes de particules en interaction : du microscopique au macroscopique (C. Toninelli) Salle 2012	<b>16h30-19h30</b> , Trading optimal haute fréquence (O. Guéant) <b>Les 07/02, 28/02, 07/03, 14/03 et 21/03 à l'ENSAE</b> <i>examen : date à préciser</i>		<b>14h45 -17h45</b> , Homogénéisation stochastique (X. Blanc) Salle 475-C bâtiment Grands Moulins	<b>13h30 - 16h30</b> , Équations rétrogrades et applications en finance (M.C. Quenez) Salle 2012

*Les examens auront lieu du 27 au 31 mars 2017*