

M2 MODÉLISATION ALÉATOIRE 2024/2025

Itinéraire : FINANCE & STATISTIQUES

Nom : Prénom :

Tél : Email :

N° ETUDIANT :

Étudiant inscrit en parallèle dans un autre établissement :

Télécom ParisTech Université Paris 1

Autre

SEMESTRE 1		SEMESTRE 2	
BLOC FONDAMENTAL (18 ECTS)			
Calcul stochastique et modèles de diffusion	C. Labbé	6	■
Modélisation des produits dérivés	S. Crépey	6	■
Introduction au Machine learning	A. Fischer	6	<input type="checkbox"/>
Chaînes de Markov	N. Cunéo	6	<input type="checkbox"/>
Modélisation des données & inférence statistique	C. Lévy-Leduc	6	<input type="checkbox"/>
COURS SPECIALISES (27 ECTS) dont au moins 2 cours à 6 ECTS			
Formation au C++	O. Carton	6	<input type="checkbox"/>
Instruments financiers	B. Bruder	3	<input type="checkbox"/>
Risques : réglementation, mesure et gestion	N. Frikha & B. Hassani	3	<input type="checkbox"/>
Analyse des séries financières	J.M. Bardet	6	<input type="checkbox"/>
Contrôle stochastique en finance	M. Talbi	6	<input type="checkbox"/>
EDP en finance et méthodes numériques	Y.Achdou & O. Bokanowski	3	<input type="checkbox"/>
Méthodes de Monte Carlo en finance	J.F. Chassagneux	6	<input type="checkbox"/>
Science des données et statistique de l'entreprise	M. Abdel-Sayed & L. Massoulard	3	<input type="checkbox"/>
Statistique des processus pour la finance	A. Gloter & A. Kebaier	6	<input type="checkbox"/>
Green finance (ENSAE)	P. Tankov & T. Roncalli	3	<input type="checkbox"/>
Copules et applications financières (ENSAE)	J-D. Fermanian	3	<input type="checkbox"/>
Apprentissage statistique	S. Cléménçon & E. Irurozki	6	<input type="checkbox"/>
Processus ponctuels et applications en finance	E. Locherbach	3	<input type="checkbox"/>
Méthodes non linéaires en finance	M.C. Quenez	3	<input type="checkbox"/>
Gestion quantitative d'actifs	B. Bruder	3	<input type="checkbox"/>
Informatique : logiciels statistiques	S. Souchet	3	<input type="checkbox"/>
Marchés de l'énergie	P. Gruet	3	<input type="checkbox"/>
Modèles avancés de la courbe des taux	Z. Grbac	6	<input type="checkbox"/>
Prédiction et investissement séquentiels	J.Y. Audibert	3	<input type="checkbox"/>
Trading algorithmique (ENSAE)	O. Guéant	3	<input type="checkbox"/>
Machine Learning en finance (ENSAE)	H. Pham & J-D. Fermanian	6	<input type="checkbox"/>
Deep XVA Analysis	S. Crepey & B. Saadeddine	3	<input type="checkbox"/>
Quantum Computing in finance	A. Jacquier	3	<input type="checkbox"/>
FinTech	L. Bertucci	3	<input type="checkbox"/>
Dynamiques du modèle de Kuramoto	B. Fernandez	3	<input type="checkbox"/>
(2 cours max validés)			
Cours ENSAE - semestre 1 -	Foundations of Risk management	J.-D. Fermanian	3 <input type="checkbox"/>
	Financial econometrics	J.-M. Zakoïan	3 <input type="checkbox"/>
Cours du M2MO externes à l'itinéraire			
Cours Externe 1		3	<input type="checkbox"/>
Cours Externe 2		3	<input type="checkbox"/>
Cours de la Chaire « Futures of Quantitative Finance »			
Advanced calibration methods and VIX derivatives	J. Guyon	3	<input type="checkbox"/>