

# M2 MODÉLISATION ALÉATOIRE 2023/2024

## 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
<b>BLOC FONDAMENTAL (18 ECTS)</b>	
<b>Calcul stochastique et modèles de diffusion</b>	<b>C. Labbé</b> 6 <input checked="" type="checkbox"/>
<b>Modélisation des produits dérivés</b>	<b>S. Crépey</b> 6 <input checked="" type="checkbox"/>
Introduction au Machine learning	A. Fischer      6 <input type="checkbox"/>
Chaînes de Markov	G. Giacomini      6 <input type="checkbox"/>
Modélisation des données & inférence statistique	S. Delattre      6 <input type="checkbox"/>
<b>COURS SPECIALISES (27 ECTS) dont au moins 2 cours à 6 ECTS</b>	
Formation au C++	O. Carton      6 <input type="checkbox"/>
Instruments financiers	B. Bruder      3 <input type="checkbox"/>
Risques: réglementation, mesure et gestion	H. Pham & B. Hassani      3 <input type="checkbox"/>
Analyse des séries financières	J.M. Bardet      6 <input type="checkbox"/>
Contrôle stochastique en finance	H. Pham      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	P. Tankov      3 <input type="checkbox"/>
Copules et applications financières	J-D. Fermanian      3 <input type="checkbox"/>
Apprentissage statistique	S. Cléménçon & P. Mozharovskiy      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	O. Guéant      3 <input type="checkbox"/>
Machine Learning en finance	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, M. Jeunesse      3 <input type="checkbox"/>
<b>(2 cours max validés)</b>	
<b>Cours ENSAE - semestre 1 -</b>	Foundations of Risk management      J.-D. Fermanian      3 <input type="checkbox"/>
	Financial markets: an introduction to Econophysics      M. Benzaquen      3 <input type="checkbox"/>
	Financial econometrics      J.-M. Zakoïan      3 <input type="checkbox"/>
<b>Cours du M2MO externes à l'itinéraire</b>	
Cours Externe 1	3 <input type="checkbox"/>
Cours Externe 2	3 <input type="checkbox"/>
<b>Cours de la Chaire «Futures of Quantitative Finance »</b>	
Advanced calibration methods and VIX derivatives	J. Guyon      3 <input type="checkbox"/>