

M2 MODÉLISATION ALÉATOIRE 2019/2020

Itinéraire : FINANCE & STATISTIQUES



Nom : Prénom :

Tél : Email :

N° ETUDIANT :

1 ^{er} trimestre	2 ^e trimestre	3 ^e trimestre	
BLOC FONDAMENTAL (18 ECTS)			
Calcul stochastique et modèles de diffusion		S. Pécché	6 ■
Modélisation des produits dérivés		S. Crépey et S. Scotti	6 ■
COURS SPECIALISES (27 ECTS) dont au moins 3 cours à 6 ECTS			
Formation au C++		O. Carton	6 <input type="checkbox"/>
Instruments financiers		B. Bruder	3 <input type="checkbox"/>
Chaînes de Markov		M. Merle	6 <input type="checkbox"/>
Modélisation des données et inférence statistique		S. Delattre	6 <input type="checkbox"/>
Introduction au Machine learning		S. Gaïffas & A. Fischer	6 <input type="checkbox"/>
Risques: réglementation, mesure et gestion		H. Pham & A. El Alami	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"/>
Processus ponctuels et applications en finance		E. Locherbach	3 <input type="checkbox"/>
EDP en finance et méthodes numériques		Y. Achdou & O. Bokanowski	3 <input type="checkbox"/>
Méthodes de Monte Carlo en finance		N. Frikha	6 <input type="checkbox"/>
Risque de crédit		R. Rouge	3 <input type="checkbox"/>
Science des données et statistique de l'entreprise		M. Abdel-Sayed & L. Massouk	3 <input type="checkbox"/>
Statistique des diffusions		A. Gloter	6 <input type="checkbox"/>
Trading algorithmique (ENSAE)		O. Guéant	3 <input type="checkbox"/>
Copules et applications financières (ENSAE)		J.-D. Fermanian	3 <input type="checkbox"/>
Apprentissage statistique		S. Cléménçon & E. Chautru	6 <input type="checkbox"/>
Méthodes non linéaires en finance		M.C. Quenez	6 <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		R. Aïd & P. Gruet	3 <input type="checkbox"/>
Méthodes probabilistes numériques avancées en finance		J.F. Chassagneux	6 <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"/>
Green finance (ENSAE)		P. Tankov	3 <input type="checkbox"/>
Machine Learning en finance (ENSAE)		H. Pham	6 <input type="checkbox"/>
Apprentissage par renforcement		J. Lussange	3 <input type="checkbox"/>
Quant analysis		S. Crepey	6 <input type="checkbox"/>
(2 cours max validés)			
Cours ENSAE - semestre 1 -	Introduction to 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"/>
	High-dimensional statistics	A. Tsybakov	3 <input type="checkbox"/>
Cours ENSAE - semestre 2 -	Artificial intelligence for actuarial studies	O. Lopez	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"/>