

M2 MODÉLISATION ALÉATOIRE 2021/2022

Itinéraire : FINANCE & STATISTIQUES



Nom : Prénom :

Tél : Email :

N° ETUDIANT :

1 ^{er} trimestre	2 ^e trimestre	3 ^e trimestre		
BLOC FONDAMENTAL (12 ECTS)				
Calcul stochastique et modèles de diffusion		S. Péché	6	■
Modélisation des produits dérivés		S. Crépey, M-C. Quenez & Z. Grbac	6	■
COURS SPECIALISES (33 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. Gálffas & A. Fischer	6	<input type="checkbox"/>
Risques: réglementation, mesure et gestion		S. Scotti & 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"/>
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"/>
Science des données et statistique de l'entreprise		M. Abdel-Sayed & L. Massoul	3	<input type="checkbox"/>
Statistique des diffusions		A. Gloter	6	<input type="checkbox"/>
Green finance (ENSAE)		P. Tankov	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"/>
Processus ponctuels et applications en finance		E. Locherbach	3	<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"/>
Trading algorithmique (ENSAE)		O. Guéant	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 -	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"/>
	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"/>