

Première partie du semestre : 5 octobre-2 décembre

2e partie du semestre : lundi 7 décembre – vendredi 15 janvier

		8 semaines, dont quelques jours banalisés			Remarques cours 1	Remarques cours 2	Remarques cours 3
		Lundis 12, 19, 26 octobre et 2, 9, 16, 23, 30 novembre					
L U N D I	09h	Stochastic Calculus (ENSTA)(M2-SFA) : 8h30-12h15			Cours court avec cycle ingénieur jusqu'au 16 nov ; puis suite du cours unigt M2-SFA		
	10h30						
	10h45						
	12H15						
	13h00						
	13h30						
	15h00						
M A R D I	15h15						
	16h45						
	17h00						
	18h30						
	Mardis 6, 13, 20, 27 oct et 10, 17, 24 nov, et 1er déc (pas 3 nov car forum Trium)						
	09h	Introduction to risk management (M2-SFA)	Actuariat de l'assurance non-vie (M2-SFA) - 1e partie à partir du 24 nov		(cours de 18h, jusqu'au 17 nov)	unigt 24 nov, 1er déc	
	10h30						
10h45							
12H15							
13h00	TD Valorisation et couverture des produits dérivés - groupes 1 et 2	Théorie microéconomique appliquée à l'assurance - 1e partie (M2-SFA)	Dynamic statistical models with hidden variables (M2-SFA)	9h de TD : 5 dates à préciser			
13h30							
15h00	Apprentissage statistique avancé (M2-SFA)			TD puis TP (salle info) les 27 oct, 17 nov et 1er déc			
15h15							
16h45							
17h00							
18h30							
Mercredis 7, 14, 21, 28 oct et 4, 18, 25 nov, 2 déc (pas mercredi 11 nov férié)							
M E R C R E D I	09h	Financial markets: an introduction to Econophysics (M2-SFA)	Dynamic optimization and reinforcement learning (M2-SFA) - option 3	Actuariat de l'assurance-vie (M2-SFA)	15h cours + 9h TD les 14 oct, 4 nov et 25 nov (attention salle info?)	6x3h=18h (sauf 18 et 25 nov)	
	10h30						
	10h45						
	12H15						
	13h00	TD Valorisation et couverture des produits dérivés - groupe 3	High-dimensional statistics (M2-DS, M2-SFA)		9h de TD : 5 dates à préciser ; priorité voie Actuariat pour le groupe 3	sauf 28 oct ; dates TD à préciser	
	13h30						
	15h00	Pricing and hedging of financial derivatives (M2-SFA)					
15h15							
16h45							
17h00							
18h30							
Jeudis 8, 15, 22, 29 octobre et 5, 12, 19, 26 novembre (joker 3 déc)							
J E U D I	09h	Financial time series (M2-SFA) - 1e partie			sauf 22 et 29 oct, y compris 3 décembre (cours de 24h+9h TD)		
	10h30						
	10h45						
	12H15						
	13h00						
	13h30						
	15h00						
15h15							
16h45							
17h00							
18h30							
Vendredis 9, 16, 23, 30 octobre et 6, 13, 20, 27 novembre (joker 4 déc)							
V E N D R E D I	09h	Hidden Markov models and Sequential Monte-Carlo methods (M2SFA, SML, DS)	Risk Theory	Physique des marchés CENTRALE (8h30-11h30) M2-SFA : à partir du 4 déc	(cours de 18h), sauf 30 oct et 6 nov	ven. 04, 11, 18 déc, 8, 15, 22, 29 jan, 5 fév	
	10h30						
	10h45						
	12H15						
	13h00	Financial Econometrics (M2-SFA)			12x2h=24h		
	13h30						
	15h00						
15h15							
16h45							
17h00							
18h30							

		4,5 semaines hors vacances de Noël 21 déc - 4 jan			Remarques cours 1	Remarques cours 2
		Lundis 7, 14 décembre et 4,11 janvier (joker 18 janvier)				
L U N D I	09h	Stochastic Calculus - cours long (ENSTA)(M2-SFA) : 8h30-12h15			Suite du cours pour M2-SFA du 23 nov au 11 jan. EXAMEN : lu 25 jan 8h30 - 10h et 10h15-11h45	
	10h30					
	10h45					
	12H15					
	13h00					
	13h30					
	15h00					
M A R D I	15h15					
	16h45					
	17h00					
	18h30					
	Mardis 8, 15 décembre et 5,12 janvier (joker 19 janvier)					
	09h	Gestion des risques de l'énergie	Actuariat de l'assurance non-vie (M2-SFA) - 2e partie		(cours de 18h, jusqu'au 17 nov)	unigt 24 nov, 1er déc
	10h30					
10h45						
12H15						
13h00	Théorie microéconomique appliquée à l'assurance - 1e partie (M2-SFA)	Dynamic statistical models with hidden variables (M2-SFA)		9h de TD : 5 dates à préciser		
13h30						
15h00	Risk measures					
15h15						
16h45						
17h00						
18h30						
Mercredis 9, 16 et 6, 13 janvier (joker 20 janvier)						
M E R C R E D I	09h	Trading algorithmique (M2-SFA, M2MO)	Actuariat de l'assurance non-vie (M2-SFA) - 3e partie, uniquement 20 jan		15h cours + 9h TD les 14 oct, 4 nov et 25 nov (attention salle info?)	6x3h=18h (sauf 18 et 25 nov)
	10h30					
	10h45					
	12H15					
	13h00					
	13h30	Copules (M2-SFA, M2MO) : 13h30-17h15	High-dimensional statistics (M2-DS, M2-SFA)		9h de TD : 5 dates à préciser ; priorité voie Actuariat pour le groupe 3	sauf 28 oct ; dates TD à préciser
	15h00					
15h15						
16h45						
17h00						
18h30						
Jeudis 10, 17 décembre et 7, 14 janvier						
J E U D I	09h	Financial time series (M2-SFA) - 2e partie			sauf 22 et 29 oct, y compris 3 décembre (cours de 24h+9h TD)	
	10h30					
	10h45					
	12H15					
	13h00					
	13h30					
	15h00					
15h15						
16h45						
17h00						
18h30						
Vendredi 11, 18 décembre et 8,15 janvier						
V E N D R E D I	09h	Duration models (M2-SFA)	Physique des marchés CENTRALE (8h30-11h30) M2-SFA : du 4 déc au 5 fév		(cours de 18h), sauf 30 oct et 6 nov	ven. 04, 11, 18 déc, 8, 15, 22, 29 jan, 5 fév
	10h30					
	10h45					
	12H15					
	13h00	Financial Econometrics (M2-SFA)			12x2h=24h	
	13h30					
	15h00					
15h15						
16h45						
17h00						
18h30						

Légende : Core courses
Specialized courses