

M2 Mathématiques et applications – Parcours Statistique et modèles aléatoires en finance

Présentation

Le parcours **Statistique et modèles aléatoires en finance** du M2 Modélisation aléatoire propose une formation d'excellence en méthodes stochastiques et statistique tournées vers les applications avec une spécialisation en finance quantitative, gestion des risques, statistique et une ouverture vers les techniques du Data Science.

STAGE

(6 mois (3 mois minimum))

Programme

ORGANISATION

Pour valider le parcours Statistique et modèles aléatoires en finance, l'étudiant doit obtenir 60 Crédits ECTS :

UE 1 Cours fondamentaux (18 ECTS) :

- Processus en finance (6ECTS)

plus 2 cours au choix parmi :

- Calcul stochastique et modèles de diffusion (6 ECTS)
- Chaînes de Markov (6 ECTS)
- Modélisation de données: base théorique (6ECTS)
- Datamining: théorie et pratique (6 ECTS)

UE 2 Cours spécialisés (24 ECTS) au choix parmi les cours de finance, statistique, data science et informatique

UE3 Stage (18 ECTS)

STAGES ET PROJETS TUTORÉS

- Soit un stage d'initiation à la recherche** effectué dans un des laboratoires universitaires sur lesquels s'appuie le master ou par un stage dans un laboratoire de recherche (INRA, INRIA, ONERA,...).

- Soit un stage professionnalisant** d'au moins 3 mois dans une entreprise éventuellement à l'étranger, sous la direction conjointe d'un tuteur responsable dans l'entreprise et d'un enseignant référent universitaire et un projet informatique.

Contacts

RESPONSABLE(S)

M. Pham Xuan-Huyen
huyen.pham@univ-paris-diderot.fr
Tel. 0157279106

CONTACT(S) ADMINISTRATIF(S)

Mme Kuntzmann Virginie
virginie.kuntzmann@univ-paris-diderot.fr
Tel. 0157279306
UFR de Mathématiques - Bâtiment S. Germain - Bureau 5055
8 rue Aurélie Nemours - Case 7012
Paris

Infos pratiques

Composante :

UFR MATHÉMATIQUES

Niveau d'études visé :

BAC +5

Formation accessible en :

Formation initiale, Formation continue

Formation à distance :

Non

Lieu d'enseignement :

LABORATOIRE(S) PARTENAIRE(S)

- [LPMA – Laboratoire de Probabilités et Modèles Aléatoires](#)

ÉTABLISSEMENT PARTENAIRES

-
- [ENSAE – École Nationale de la Statistique et de l'administration Économique](#)
- [Télécom ParisTech](#)
- [CentraleSupélec](#)