

Emploi du temps 2025-2026 - 1er semestre
ENSAE **MASTER SFA**

Emploi du temps strictement indicatif. Seul Pamplémousse fait foi.
 1ère partie du semestre : mardi 30 Sept. - vendredi 28 novembre

		9 semaines, dont quelques jours banalisés				Remarques cours 1	Remarques cours 2	Remarques cours 3	Remarques cours 4
		Lundis 6, 13, 20, 27 Oct. et 3, 10, 17, 24 Nov. 8 jours							
L U N D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Stochastic Calculus (ENSTA) : 8h30-12h15	Stochastic Calculus (ENSTA) M2-SFA long course : 8h30-12h30 - Part 1			6 * 3h30 : 6, 13, 20 Oct, 3, 10, 17 Nov 2h cours puis 1h30 TD sauf 1ère séance 3h30 cours	6 * 3h30 : 24 Nov.		
	13h00 13h30 15h00	Dynamic optimization and reinforcement learning - part 1				9 * 2h : 6, 13, 20, 27 Oct, 3, 10, 17, 24 Nov			
	15h15 16h45 17h00 18h30	Financial Time Series part 1				11*3h dont 9h TD: 6, 13, 20 Oct, 3, 10 (TD), 17, 24 Nov			
		Mardis 30 Sept. et 7, 14, 21, 28 Oct. et 4, 18, 25 Nov. (sauf 11 Nov. Férié) 8 jours							
M A R D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Machine-learning for Portfolio Management and Trading	Mathématiques de l'assurance dommages part 2	Actuariat de l'assurance-vie part 1		6 * 3h: 30 Sept, 7, 14, 21 Oct, 18, 25 Nov	7, 21, 28 Oct, 4, 18, 25 Nov	8*3h entre 4 professeurs 30 Sept, 14 Oct	
	13h00 13h30 15h00	Financial Econometrics - Part 1	Théorie microéconomique appliquée à l'assurance - part 1			12 * 2h dont 6h TD: 30 Sept, 7, 14, 21, 28 Oct, 4, 18, 25 Nov	21h : 9 * 2h + 3h 2h: 30 Sept, 7, 14, 21, 28 Oct, 4, 18, 25 Nov		
	15h15 16h45 17h00 18h30	Advanced machine learning - part 1	Applied Statistical Learning			10 * 3h. 21h cours & 9h TD: 30 Sept. et 7, 14, 21, 28 Oct. et 4, 18, 25 Nov.	8 * 3h à répartir entre Cours (15h) & TD (9h): 30 Sept. et 7 (TD), 14, 21, 28 Oct. et 4(TD), 18, 25 (TD) Nov		
		Mercredis 1, 8, 15, 29 Oct. Et 5, 12, 19, 26 Nov. (sauf 22 Oct. forum) 8 jours							
M E R C R E D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Hidden Markov models and Sequential Monte-Carlo methods	Mathématiques de l'assurance dommages part 1	Actuariat de l'assurance-vie part 2	Green Finance Core Notions 1	6 * 3h : 1, 8, 15, 29 Oct 5, Nov. + soutenance 9 janvier	1, 15 Oct	5, 12, 19, 26 Nov	8 * 3h : 1, 8, 15 Oct. 5, 12, 19, 26 Nov
	13h00 13h30 15h00	TD Pricing and hedging of financial derivatives - groupe 1 à 3	High-dimensional statistics - part 1			5 * 2h : 15, 29 Oct, 5, 19, 26 Nov	12 * 2h dont 10h TD 1, 8, 15, 29 (TD) Oct, 5, 12, 19 (TD), 26 (TD) Nov		
	15h15 16h45 17h00 18h30	Pricing and hedging of financial derivatives - cours 1	Foundations of Risk management - part 1			8 * 3h : 1, 8, 15, 29 Oct. 5, 12, 19 Nov	6 * 3h à répartir 26 Nov		
		Jeudis 2, 9, 16, 23, 30 Oct. et 6, 13, 20, 27 Nov. 9 jours							
J E U D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Mathematical finance in discrete time part 1 8h-11h15 - S2 Class starting in S1				7 * 3h : 6, 13 Nov			
	13h00 13h30 15h00								
	15h15 16h45 17h00 18h30								
		Vendredis 3, 10, 17, 24, 31 Oct. et 7, 14, 21, 28 Nov. 9 jours							
V E N D R E D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15		Risk Theory				21h à répartir entre cours (15h) & TD (6h) : 7 * 3 3, 10, 17, 24, 31 Oct. 7, 14 Nov		
	13h00 13h30 15h00	Conf Pro ACPR	Dynamic models with latent variables (M2-SFA)			14 novembre.	6*2h: 3, 10, 17, 24, 31 Oct, 7 Nov		
	15h15 16h45 17h00 18h30	Pricing and hedging of financial derivatives - cours 2	ML for Climate Risk			7 Novembre	5*3h: 3, 10, 17, 24, 31 Oct		

		2e partie du semestre : lundi 1 décembre – mercredi 14 janvier			Remarques cours 1	Remarques cours 2	Remarques cours 3
		4,5 semaines hors vacances de Noël 20 décembre - 4 janvier					
		Lundis 1, 8, 15 Déc. et 5, 12 Jan. 5 jours					
L U N D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Stochastic Calculus (ENSTA) M2-SFA long course : 8h30-12h30 - Part 2	Stochastic Calculus short Exam		1, 8, 15 Déc, 5, 12 Janv	19 Jan 8h30-10h	
	13h00 13h30 15h00	Dynamic optimization and reinforcement learning - part 2			1 Déc.	19 Jan 10h30-12h00	
	15h15 16h45 17h00 18h30	Financial Time Series part 2			1 (TD), 8, 15 Déc 5 (TD) Jan		
		Mardis 2, 9, 16 Déc. et 6, 13 Jan. 5 jours					
M A R D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Modeling and managing energy risks	Théorie microéconomique appliquée à l'assurance - part 3	Actuariat de l'assurance-vie part 3	4 * 3h : 2, 9, 16 Déc 6 Jan	3h: 16 décembre	2, 9 Déc.
	13h00 13h30 15h00	Financial Econometrics - Part 1	Théorie microéconomique appliquée à l'assurance - part 2		2(TD), 9, 16(TD) Déc, 6 Jan (TD)	2 Déc.	
	15h15 16h45 17h00 18h30	Advanced machine learning - part 2	Risk measure		2; 9, 16 Déc	4 * 3h : 2, 9, 16 Dec, 6 Jan	
		Mercredis 3, 10, 17 Déc. et 7, 14 Jan. 5 jours					
M E R C R E D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Copulas and financial applications (M2-SFA, M2MO) : 9h00-12h45			5x3h30 3, 10, 17 Dec, 7, 14 Jan.		
	13h00 13h30 15h00		High-dimensional statistics - part 2			3, 10 Déc 7 (TD), 14 (TD) Jan	
	15h15 16h45 17h00 18h30		Foundations of Risk management - part 2			3, 10, 17 Déc, 7, 14 Jan.	
		Jeudis 4, 11, 18 Déc. et 8 Jan. 4 jours					
J E U D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Mathematical finance in discrete time part 2 8h-11h15 - S2 Class starting in S1			4, 18 December 8 January		
	13h00 13h30 15h00						
	15h15 16h45 17h00 18h30						
		Vendredis 5, 12, 19 Déc. et 9 Jan. 4 jours					
V E N D R E D I	09h 10h30 10h45 12H15 12H15	Hidden Markov models and Sequential Monte-Carlo methods - soutenance	Green Finance Core Notions 2	Mathematical finance in discrete time part 3 8h15-11h30 - S2 Class starting in S1	9 Jan. Soutenance	19 Décembre.	23, 30 janvier Exam : 13 février
	13h00 13h30 15h00						
	15h15 16h45 17h00 18h30						

Session principale d'examens : semaine du lundi 19 au vendredi 23 janvier
 Rattrapages session principale : Semaine du 16 au 20 mars

Légende :

- Core courses
- Core courses actuaries
- Specialized courses