

Informatique appliquée la finance

ECTS:3

Description du contenu de l'enseignement :

- 1. Bases de Python
- 2. Numpy et Panda
- 3. Traitement des séries temporelles
- 4. Régression linéaire et application en finance
- 5. Application de Python à des problèmes de finance : choix de portefeuilles, modèles à facteurs...

Compétence à acquérir :

Maîtrise des bases de Python (principales opérations, importation et manipulation des données). Application de Python en finance.

Mode de contrôle des connaissances :

Projet (par groupe de deux étudiants).

Bibliographie, lectures recommandées :

Yves Hilpisch, « Python for Finance », 2019, Editions O'Reilly.

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16 - 04/11/2025