

Python pour l'analyse de données financières en temps réel

ECTS : 6

Description du contenu de l'enseignement :

- Seance 1: Introduction + test de niveau pour construire les groupes de travail.
- Seance 2 -> 5: Remise à niveau Python.
- Seance 6: Analyse et visualisation des données financières - detection d'opportunités d'arbitrage via analyse de carnets d'ordres sur plusieurs marchés.
- Seance 7: Delta Hedging automatisé - liquidité et market impact instantané - KPIs d'execution optimale.
- Seance 8: Smart order routing et applications.
- Seance 9: présentation des papiers de recherche.
- Seance 10: Examen final

Compétence à acquérir :

- Bases développement python - techniques d'entretiens pour les élèves les plus avancés.
- principes de trading algorithmique, automated hedging, automated market making et execution optimale.

Mode de contrôle des connaissances :

- 20% : moyenne de 5 Quizzes de 10 min
- 40% Présentation d'un papier de recherche en groupe
- 20% Examen finale écrit
- 20% Examen de code et d'interprétation

Document susceptible de mise à jour - 31/05/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16