Python pour l'analyse de données financières en temps réel

ECTS : 6

Langue du cours : Français

Volume horaire : 27

Description du contenu de l'enseignement :

- Seance 1: Introdution + 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

Compétences 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 Quizzs de 10 min

- 40% Présentation d'un papier de recherche en groupe

- 20% Examen finale écrit

- 20% Examen de code et d'interprétation

Coefficient : 2.00