

Exploitation des données massives en finance

Infos pratiques

- > ECTS : 1.5
- > Nombre d'heures : 16.0
- > Langue(s) d'enseignement : Français
- > Période de l'année : Enseignement dixième semestre
- > Méthodes d'enseignement : En présence
- > Forme d'enseignement : Travaux dirigés
- > Ouvert aux étudiants en échange : Oui
- > Composante : Sciences économiques, gestion, mathématiques et informatique
- > En savoir plus : <https://sites.google.com/view/mastergda>

Présentation

- Définition du concept de données massives. Concept des 3Vs.
- Présentation de sources de données boursières et financières gratuites ou commerciales
- Récupération de données disséminées sur le WEB à l'aide d'outils de Scraping
- De la donnée brute à la donnée exploitable : préparation des données comme input de modèles
- Introduction concept d'apprentissage statistique, classification, régression, panoplie de modèles existants
- Régularisation des données : overfitting, underfitting, hyperparametre et gestion de la variance
- Arbres de décisions, forêts aléatoires
- Introduction aux Réseaux de Neurones Artificiels (ANN) et leurs dérivés (RNN, ...)

Objectifs

L'objectif du présent cours-TD est double. A l'aide de Python, nous explorerons d'abord les problématiques liées à la gestion de données massives (Big Data). Une fois ces données retraitées convenablement, nous

présenterons quelques méthodes de Machine-Learning utiles pour la régression et classification.

Le cours prendra la forme d'une conférence interactive (comme une PyConf).

Évaluation

Évaluation écrite (partiel traditionnel)

Pré-requis nécessaires

Compétence intermédiaire ou avancée en programmation Python et R

Compétences visées

Python : utilisation avancée des packages Pandas & Scikit Learn

Finance : connaissance de l'éventail des bases de données disponibles

Scraping : Extraction de données disséminées sur le WEB

BIG data : De la donnée brutes à la donnée exploitable

ML : Arbre de décision, Forêt Aléatoire, ANN, RNN

Bibliographie

Hastie, T., Tibshirani, R., & Friedman, J. (2009). The elements of statistical learning: data mining, inference, and prediction. Springer Science & Business Media

Bishop, C. M. (2006). Pattern recognition and machine learning. springer.

Richert, W. (2013). Building machine learning systems with Python. Packt Publishing Ltd

Harrington, P. (2012). Machine learning in action. Manning Publications Co..

Ressources pédagogiques

Classe interactive