



Offre de stage de Master 2

Apprentissage statistique profond (*Deep Learning*)
pour l'analyse de séries financières

Vivienne Investissement - Lyon

L'objet de ce stage réside dans l'étude du potentiel apporté par des techniques d'"apprentissage statistique profond" (*Deep Learning*) à l'analyse de séries financières. Il s'agira d'une part d'étudier comment des outils type GAN (Generative Adversarial Network) permettent la génération automatique de séries financières artificielles, c'est-à-dire de séries synthétiques qui en reproduisent le mieux possible les statistiques-clés.

Nous nous concentrerons d'abord sur la synthèse de copie d'une seule série temporelle, puis nous essaierons ensuite une modélisation multivariée (plusieurs séries temporelles analysées conjointement). Dans un deuxième temps - et selon la progression de la première partie, nous nous intéresserons à la classification automatique de ces séries financières en classes d'actifs, dont les attributs sont appris automatiquement par des architectures d'apprentissage statistique profond.

Les investigations seront conduites en python et/ou matlab principalement.

Le stage se déroulera à Lyon, chez Vivienne Investissement, société de gestion d'actifs quantitative, en collaboration avec le Laboratoire de Physique de l'ENS de Lyon.

Dates : Avril - Juillet 2019

Durée : 4-6 mois

Pour postuler

Merci d'adresser vos candidatures avec un CV et une brève lettre de motivation à :
blaustriat@vivienne-im.com et pabry@vivienne-im.com

Site web : www.vivienne-investissement.com