

Livres sur l'Algo Trading et l'Ingénierie Financière

Débutant à intermédiaire - Pour comprendre et démarrer

- Quantitative Trading - Ernest Chan (Matlab / Python)
 - > Introduction claire à l'algo trading, avec exemples simples
- Python for Finance - Yves Hilpisch (Python)
 - > Excellente porte d'entrée vers la finance quantitative avec Python
- My Life as a Quant - Emanuel Derman (Autobiographique / Vulgarisation)
 - > Témoignage d'un ex-quant chez Goldman Sachs
- Algorithmic Trading - Ernest Chan (Python / Théorie + pratique)
 - > Suite du livre précédent, plus orienté stratégie
- Machine Trading - Ernest Chan (Python / ML)
 - > Plus technique, mais encore accessible

Intermédiaire à avancé - Pour consolider les bases et modéliser

- Machine Learning for Asset Managers - Marcos López de Prado (Python / Théorique)
 - > Approche pratique du ML pour portefeuille
- Advances in Financial Machine Learning - M. L. de Prado (Python / Avancé)
 - > Référence moderne du ML en finance
- Python for Algorithmic Trading - Yves Hilpisch (Python / Implémentation)
 - > Implémentation pratique de stratégies
- Algorithmic and High-Frequency Trading - Álvaro Cartea, S. Jaimungal (Mathématique / HFT)
 - > Académique et quantitatif
- Quantitative Finance For Dummies - Steve Bell (Généraliste / Accessible)
 - > Résumé des notions clés pour non-matheux

Avancé à expert - Mathématiques financières, modèles, risk management

- Options, Futures, and Other Derivatives - John Hull (Théorique / Universitaire)
 - > Référence mondiale en ingénierie financière
- Paul Wilmott on Quantitative Finance - Paul Wilmott (Théorique / Mathématique)
 - > Très dense, quasi encyclopédie du quant
- Monte Carlo Methods in Finance - Peter Jäckel (Mathématique / C++)
 - > Simulation stochastique
- Risk and the Financial Crisis - Robert Engle (Macro / Risque)
 - > Risque systémique et GARCH
- Financial Modelling - Simon Benninga (Excel / VBA)
 - > Compréhension des mécanismes en tableur

Biographies, récits et coulisses (inspirants mais non techniques)

- The Man Who Solved the Market - Gregory Zuckerman (Jim Simons / Renaissance Tech)
 - > Fascinant, sans révéler les stratégies
- Flash Boys - Michael Lewis (HFT / BATS / IEX)
 - > Accessible, polémique sur le HFT
- Dark Pools - Scott Patterson (Bourses électroniques / Algo)
 - > Développement du trading automatisé
- More Money Than God - Sebastian Mallaby (Hedge funds)
 - > Inclut Renaissance, DE Shaw, etc.