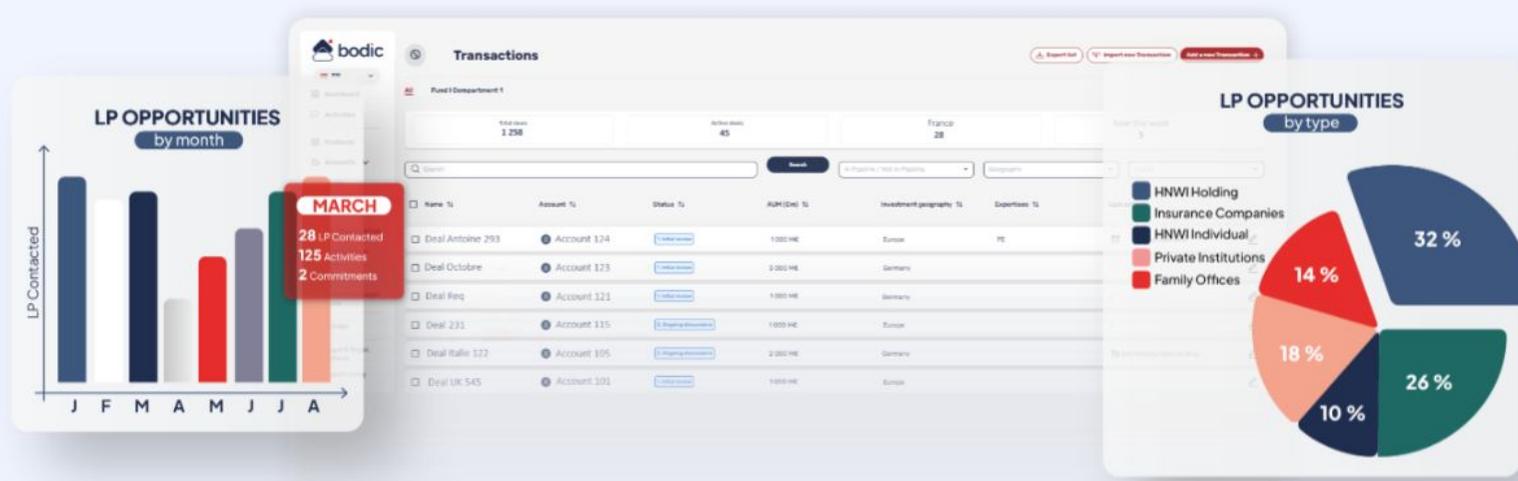




Votre partenaire DATA pour optimiser
les performances de votre société de gestion



Les Fiches Pratiques IA DATA

5 minutes pour comprendre un concept technique

**F#10 : Analyser des séries temporelles pour
mieux piloter vos participations et vos équipes**

Juillet 2025

www.bodic.eu

Pourquoi parler d'analyse de séries temporelles ?

Dans les sociétés de gestion, **les données stratégiques évoluent dans le temps** : valorisation des participations, cash-flows, volume de deals, indicateurs ESG...

Pourtant, elles sont souvent consultées de façon **ponctuelle**, sans **recul historique** ni **projection**.

Pour y remédier, il existe des méthodes simples et éprouvées pour **analyser, visualiser et anticiper** les tendances temporelles, afin de :

- Suivre la **performance réelle** des participations
- Optimiser les **ressources** (IR, back/middle, Support,...)
- Détecter des **signaux faibles** de KPI opérationnels
- Mieux planifier les **flux de trésorerie** et les **besoins**

Qu'est-ce qu'une série temporelle ?

Une série temporelle est une **séquence de données indexée dans le temps**.

Dans une société de gestion ou une PME, on en trouve partout :

- Évolution trimestrielle de la **valorisation** des participations
- **Cash-flow** entrants ou sortants sur le portefeuille
- **Volume de deals** analysés, présentés ou signés par mois
- **Indicateurs ESG** trimestriels sur les participations

Analyser une série temporelle n'est pas réservé aux data scientists

Chaque collaborateur, qu'il soit en front, middle ou support, peut **monter en compétences** pour faire **parler ses données** et gagner en **efficacité** au quotidien.

Quels modèles utiliser ?

Il n'existe pas un modèle unique pour analyser une série temporelle, mais plusieurs **approches complémentaires** selon le niveau de maturité, le volume de données disponible et l'objectif visé (visualisation, prévision, détection d'anomalies, ...). Le plus important est de choisir une **méthode adaptée à la complexité du signal** et à la **capacité d'exploitation** en interne.

Modèle	Type	Points forts	Limites
ARIMA	Statistique classique	Interprétable, léger, robuste	Peu adapté aux relations non linéaires
Prophet	Open source	Facile, capte saisonnalité / tendance	Moins bon sur les séries complexes
XGBoost	ML supervisé	Performant avec bonnes features	Besoin d'ingénierie temporelle
LSTM	Deep learning	Capte dynamiques longues et complexes	Opaque, gourmand en données

Quelques outils pour vos analyses

Quelques librairies Python recommandées :

- **statsmodels** pour ARIMA
- **prophet** (installable via **prophet** ou **fbprophet**)
- **xgboost** avec **scikit-learn**
- **tensorflow** ou **pytorch** pour LSTM

En Excel, Google Sheets ou LibreOffice :

- Analyse de tendance par la méthode des **moindres carrés**
- **Moyennes mobiles / différenciation**
- Graphiques avec **lignes de tendance** (polynômiales, exponentielles...)

Quelques cas d'usage en société de gestion

1

Prévision des cash-flows sur le portefeuille,
participation par participation

2

Suivi des indicateurs ESG dans le temps :
anticiper les alertes ou les ruptures de trajectoire

3

Dimensionnement de l'équipe Invest :
modéliser la charge de travail en fonction
du volume de dossiers entrants (pipeline)

4

Suivi de la performance des participations :
CA, EBITDA, effectifs, récurrence...

À retenir

- Pour piloter efficacement, il convient d'utiliser des modèles dédiés (**ARIMA**, **Prophet** et même des analyses **Excel**).
- Une bonne analyse temporelle permet d'**anticiper**, de **prioriser** et de **mieux allouer les ressources**.
- Les **LLM** ne savent pas prédire l'avenir d'une série temporelle, mais ils peuvent en **améliorer l'exploitation** : Génération de commentaires automatiques, lecture de documents qualitatifs associés, création d'alertes textuelles sur seuils, ...

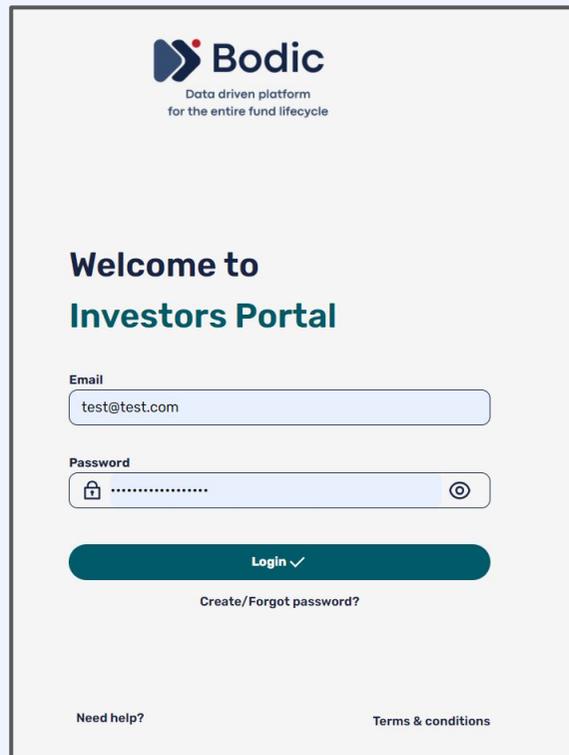
Vous souhaitez débiter sur ce sujet d'analyse de séries temporelles ? **Bodic** vous accompagne dans le cadrage, le choix des données et modèles adaptés, et la montée en compétence de vos équipes : contact@bodid.eu

Cette fiche vous a plu ? N'hésitez pas à partager ce post !

Envie d'aller
plus loin ?

Découvrez nos
solutions sur
www.bodic.eu

contact@bodic.eu



Bodic
Data driven platform
for the entire fund lifecycle

Welcome to
Investors Portal

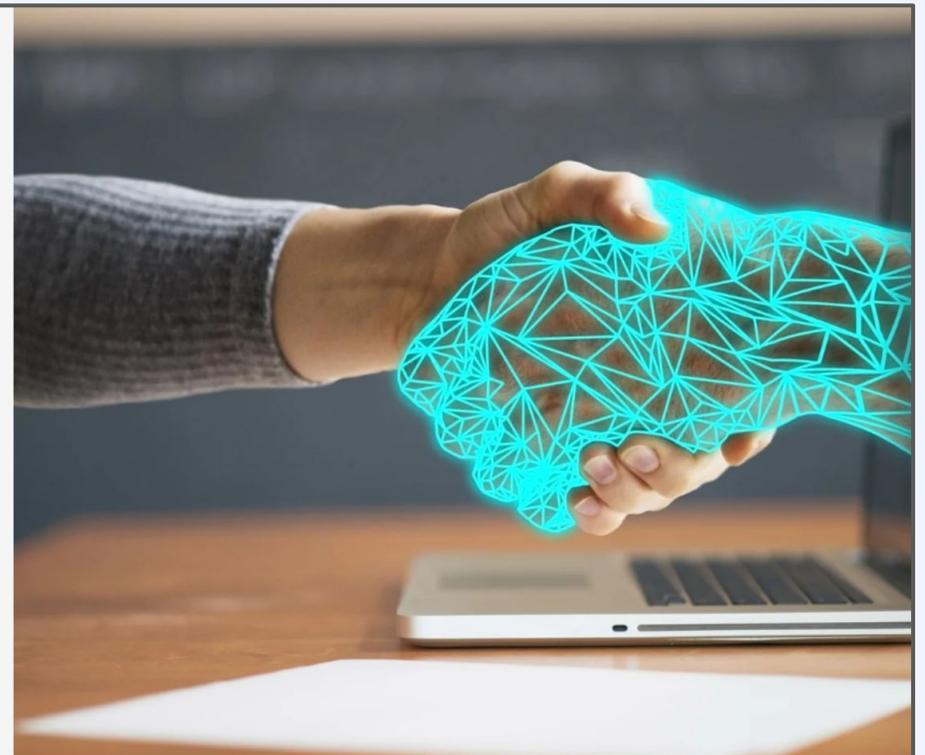
Email

Password

Login ✓

[Create/ Forgot password?](#)

[Need help?](#) [Terms & conditions](#)



Les 10 points
d'une digitalisation réussie
pour une société de gestion

- LIVRE BLANC 2025 -

Télécharger
notre livre blanc

