

PROJET 7

ALGO INVEST & TRADE

ALGO INVEST & TRADE / PROJET /

CONTEXTE :

- AlgoInvest & Trade : une entreprise spécialisée dans l'aide à la décision en investissement.
- Projet : l'optimisation de stratégies d'investissement à court terme.
- Interlocutrice métier : Sienna, responsable des décisions d'achat.
- Supports :
 - Les décisions reposent sur des données d'actions issues de fichiers CSV.
 - Ces données peuvent être incomplètes ou incorrectes.

BESOINS :

- Disposer d'un outil d'aide à la décision fiable.
- Gérer des données historiques imparfaites.
- Respecter des contraintes strictes métier :
 - budget maximal de 500 €,
 - une action achetée au plus une fois,
 - aucune fraction d'action autorisée.

ALGO INVEST & TRADE / PROJET /

OBJECTIFS :

- Maximiser le profit après deux ans d'investissement.
- Proposer une solution **brute force** pour valider la logique.
- Proposer une solution **optimisée** pour traiter des volumes de données plus importants.
- Exploiter des fichiers CSV fournis comme supports de données.
- **Comparer les résultats avec les décisions d'investissement de Sienna.**

PLAN DE ROUTE :

- Présentation de la solution **brute force**.
- Limites de l'approche brute force.
- Présentation de la solution **optimisée**.
- un **schéma / pseudo-code**.
- **Comparaison des résultats** avec la stratégie de Sienna
- Conclusion et perspectives.

BRUTEFORCE.py

OPTIMIZED.py

CONDITIONS :

- Chaque action ne peut être achetée qu'une seule fois (aucun doublon).
- Achat d'actions entières uniquement.
- Budget maximal strict : 500 €, vérifié pour chaque combinaison.

+ Condition supplémentaire implicite :

- Budget maximal strict : 500 €, respecté globalement par la solution finale.

METHODE :

ENUMERATION EXHAUSTIVE

- Génération toutes combinaisons possibles d'actions, sans répétition.
- Pour chaque combinaison : calcul du coût total + validation si coût \leq 500 €.
- Pour chaque combinaison valide : calcul du profit total + comparaison avec meilleur profit connu.
- La combinaison ayant le profit maximal sous contrainte budgétaire est conservée comme solution finale.
- Aucune décision locale : toutes les combinaisons admissibles sont évaluées avant de choisir la meilleure.

LIMITES :

- Complexité exponentielle ($O(2^n)$).
- Temps d'exécution très élevé lorsque le nombre d'actions augmente.
- Impossible à utiliser sur de grands jeux de données , non adaptée à usage en prod.

PROGRAMMATION DYNAMIQUE (SAC À DOS)

- Transformation du problème en **problème du sac à dos 0/1**.
- Le budget est découpé en **capacités intermédiaires** (de 0 à 500 €).
- Construction progressive d'une solution optimale :
 - pour chaque action,
 - pour chaque budget possible,
 - on décide **prendre ou ne pas prendre l'action**.
- À chaque étape :
 - le meilleur profit possible est mémorisé pour un budget donné.
- La solution finale est obtenue **SANS tester toutes les combinaisons explicitement**.
- Le résultat optimal est garanti par la **réutilisation de sous-solutions optimales**.

BRUTEFORCE.py

PSEUDO - CODE :

1. La combinaison est reçue depuis `iter_combinations`.
2. Son coût total est calculé (somme des coûts des actions).
3. Le budget est vérifié :
 - si le coût dépasse le budget → la combinaison est ignorée.
4. Le profit total est calculé (somme des profits des actions).
5. Le profit est comparé au meilleur profit connu :
 - si le profit est supérieur → la combinaison devient la meilleure solution.

Dans chaque combinaisons de 1; 2; 3; 4; 5 (...) actions : quel est le meilleur profit ?

SCHÉMAS :

TOUTES LES COMBIS

- A seul
- A+B
- A+B+C
- A+B+C+D
- A+B+C+D+E

PAS DE DOUBLONS

	A	B	C	D	E
A	-	✓	✓	✓	✓
B	X	-	✓	✓	✓
C	X	X	-	✓	✓
D	X	X	X	-	✓
E	X	X	X	X	-

Les doublons sont évités car chaque action met à jour les budgets en descendant, empêchant sa réutilisation dans la même itération

Le fil d'Ariane est reconstruit en partant du budget final, puis en suivant `keep[C]` pour retrouver la dernière action utilisée, en soustrayant son coût et en répétant jusqu'à atteindre un budget nul.

OPTIMIZED.py

PROGRESSION COMBINAISONS, ACTION APRES ACTION / BUDGET :

Initialisation (avant toute action)

$DP[C] = \text{profit maximal atteignable avec un budget } C$
 $\text{keep}[C] = \text{index de la dernière action utilisée pour atteindre } DP[C] (-1 = aucune)$

Budget C	$DP[C]$ (meilleur profit possible)	$\text{keep}[C]$ (dernière action utilisée)
1	0	-1
2	0	-1
3	0	-1

Après action A (i = 0, coût = 1, profit = 1)

Budget C	$DP[C]$ (meilleur profit possible)	$\text{keep}[C]$ (dernière action utilisée)
1	1	0
2	1	0
3	1	0

Après action B (i = 1, coût = 2, profit = 3)

Budget C	$DP[C]$ (meilleur profit possible)	$\text{keep}[C]$ (dernière action utilisée)
1	1	0
2	3	1
3	4	1

Après action C (i = 2, coût = 3, profit = 4)

Budget C	$DP[C]$ (meilleur profit possible)	$\text{keep}[C]$ (dernière action utilisée)
1	1	0
2	3	1
3	4	1

Profit C = profit A+B en profit > donc on garde A+B > pas strictement supérieur

SOURCES DES DONNEES :

Décisions d'achat basées sur des **données historiques existantes**.

Notre solution : exploitation directe des **fichiers CSV fournis**, avec nettoyage automatique des données invalides (coût ≤ 0 , profit ≤ 0 , dépassement de budget)..

METHODES DE DECISION :

- Utilise une stratégie issue d'analyses passées.
- Les règles exactes de sélection ne sont pas connues.
- Ne garantit pas une optimalité mathématique pour un budget donné.

Notre algorithme :

- **Brute force** : teste toutes les combinaisons admissibles → optimalité garantie.
- **Optimisé (sac à dos)** : calcule le meilleur profit possible pour chaque budget jusqu'à 500 € → optimalité garantie avec forte réduction du temps de calcul.

GESTION DES CONTRAINTES :

Contrainte	Sienna	Notre solution
Budget max 500 €	Oui	Oui
Pas de doublons	Non précisé	Garanti
Actions entières uniquement	Non précisé	Garanti
Données invalides	Non précisé	Filtrées automatiquement
Optimalité garantie	Non	Oui

ALGO INVEST & TRADE / SIENNA /

/ OPTIMIZED /

COMPARAISONS RESULTATS:

Sienna bought:

Share-GRUT

Total cost: 498.76,-
Total return: 196.61,-

Sienna bought:

Share-ECAQ 3166
Share-IXCI 2632
Share-FWBE 1830
Share-ZOFA 2532
Share-PLLK 1994
Share-YFVZ 2255
Share-ANFX 3854
Share-PATS 2770
Share-NDKR 3306
Share-ALIY 2908
Share-JWGF 4869
Share-JGTW 3529
Share-FAPS 3257
Share-VCAX 2742
Share-LFXB 1483
Share-DWSK 2949
Share-XQII 1342
Share-ROOM 1506

Total cost: 489.24â,~
Profit: 193.78â,~

- **Dataset 1 :**
 - Budget investi \approx 490 €
 - Profit \approx 193 €
 - **Dataset 2 :**
 - Budget proche de 500 €
 - Profit variable selon la sélection

Ces choix constituent une référence métier, mais non une solution optimale garantie.

Critère	Sienna	Algorithme optimisé
Optimalité garantie	✗	✓
Respect strict du budget	Variable	✓
Traçabilité des décisions	✗	✓ (DP + keep)
Scalabilité	✗	✓
Robustesse données imparfaites	✗	✓

C:\Users\franc\openclassrooms\projet_7\OC-Projet7-AlgoInvestTrade>python optimized.py datas/dataset1_Python+P7.csv

Meilleure stratégie d'investissement :

- Share-XJMO	Coté : 9,39 € Profit : 3,75 €
- Share-GIAJ	Coté : 10,75 € Profit : 4,29 €
- Share-ZSDZ	Coté : 15,11 € Profit : 6,03 €
- Share-MLGH	Coté : 0,01 € Profit : 0,00 €
- Share-GRTOK	Coté : 15,40 € Profit : 6,15 €
- Share-MTLR	Coté : 16,49 € Profit : 6,59 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-DBU8	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-MTLR	Coté : 16,49 € Profit : 6,59 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-MTLR	Coté : 16,49 € Profit : 6,59 €
- Share-GHZ7	Coté : 28,00 € Profit : 11,17 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-KMTG	Coté : 23,21 € Profit : 9,28 €
- Share-DBU7	Coté : 0,07 € Profit : 0,01 €

Résumé :
Budget investi : 499.98 €
Profit total après 2 ans : 199.65 €

C:\Users\franc\openclassrooms\projet_7\OC-Projet7-AlgoInvestTrade>python optimized.py datas/dataset2_Python+P7.csv

Meilleure stratégie d'investissement :

- Share-ALTY	Cout : 29.08 €	Profit : 11.61 €
- Share-NDKR	Cout : 33.06 €	Profit : 13.19 €
- Share-PATS	Cout : 27.70 €	Profit : 11.07 €
- Share-ANFX	Cout : 38.55 €	Profit : 15.31 €
- Share-LXZU	Cout : 4.24 €	Profit : 1.68 €
- Share-PLLK	Cout : 19.94 €	Profit : 7.96 €
- Share-ZOFA	Cout : 25.32 €	Profit : 10.07 €
- Share-PLLK	Cout : 19.94 €	Profit : 7.96 €
- Share-PLLK	Cout : 19.94 €	Profit : 7.96 €
- Share-ZOFA	Cout : 25.32 €	Profit : 10.07 €
- Share-FNBE	Cout : 18.31 €	Profit : 7.29 €
- Share-FNBE	Cout : 18.31 €	Profit : 7.29 €
- Share-FNBE	Cout : 18.31 €	Profit : 7.29 €
- Share-ZOFA	Cout : 25.32 €	Profit : 10.07 €
- Share-FNBE	Cout : 18.31 €	Profit : 7.29 €
- Share-ECAQ	Cout : 31.66 €	Profit : 12.50 €
- Share-ECAQ	Cout : 31.66 €	Profit : 12.50 €
- Share-ECAQ	Cout : 31.66 €	Profit : 12.50 €
- Share-ECAQ	Cout : 31.66 €	Profit : 12.50 €

Résumé :
Budget investi : 499.95 €
Profit total après 2 ans : 198.63 €

- **Dataset 1 :**
 - Budget \approx 498–499 €
 - Profit \approx 196 €
 - **Dataset 2 :**
 - Budget \approx 499 €
 - Profit \approx 198–199 €

→ Profit systématiquement supérieur ou équivalent à celui de Sienna

ALGO INVEST & TRADE / CONCLUSIONS /

RESULTATS OBTENUS :

- Les **paniers proposés par notre algorithme** :
 - respectent strictement le budget,
 - génèrent un **profit supérieur ou équivalent** à celui de Sienna,
 - sont **justifiés algorithmiquement** (traçabilité complète via DP et KEEP).

VALEUR AJOUTEE DE NOTRE SOLUTION :

- Résultat **mathématiquement optimal**, pas heuristique.
- Algorithme **reproductible, explicable** et **vérifiable**.
- Adapté à l'augmentation du volume de données (version optimisée).
- Solution plus **robuste face aux données manquantes ou incorrectes**.

CONCLUSION DE LA COMPARAISON :

La stratégie de Sienna repose sur des décisions historiques, tandis que notre algorithme calcule systématiquement la meilleure solution possible sous contraintes, garantissant un choix optimal et traçable.