



DataScientest • com

OPA : Online Portfolio Allocation

Cursus concerné : Data Scientist / Data Analyst

Difficulté : 6/10

Description détaillée

Le monde financier et bancaire figure parmi les secteurs d'activités générant le plus de données et le plus souvent en libre accès. Le domaine d'allocation de portefeuille est particulièrement intéressant au sens où il est abondant en données et systématisable.

L'objectif de ce projet est de créer un modèle d'allocation de portefeuille qui adapte sa stratégie "online", mais aussi d'adapter l'approche machine learning à un secteur d'activité présentant des points communs.

Data

Datasets classiques du secteur :

- NYSE
- DJA
- TSE

Possibilité de créer ses données à l'aide des api de finance :

- yahoo finance
- google finance

Bibliographie

<http://papers.nips.cc/paper/2453-can-we-learn-to-beat-the-best-stock.pdf>
<https://icml.cc/2012/papers/168.pdf>

Et de nombreuses autres références.

Conditions de validation du projet

- Exploration des données
- Dataviz'
- Rapport et codes
- Démo sur un cas actuel et conclusions.
- Approfondissement possible avec le volet DE correspondant.