

IFT6512 – Programmation stochastique

Devoir 2

Date de remise : 28 novembre 2023.

Le devoir est individuel. Le règlement sur le plagiat sera de stricte application.

Considérons le problème d'allocation de portefeuille avec des contraintes en chance vus au cours.

Adaptez le notebook Julia pour reproduire les résultats obtenus par Pagnoncelli et al., “Sample Average Approximation Method for Chance Constrained Programming : Theory and Applications”, 2009, Section 3, en sélectionnant 10 actifs depuis la base de données disponible sur Kaggle à l'adresse <https://www.kaggle.com/datasets/jacksoncrow/stock-market-dataset>.

Note : vous pouvez partir de <https://www.kaggle.com/code/artemburenok/stock-analysis-monte-carlo-build-portfolio> pour analyser les données.