**Stratégie : Minimum Variance**

**Description**

La stratégie **Minimum Variance** consiste à sélectionner les actifs présentant la plus faible volatilité sur une période passée (fenêtre rétrospective) et à les conserver pendant une période donnée (période de reroll), avant de réévaluer et de réallouer le portefeuille avec les actifs les moins volatils.

Cette approche repose sur l'idée que la volatilité est un indicateur clé du risque, et que minimiser celle-ci permet d'améliorer le couple rendement/risque du portefeuille.

**Implémentation de la stratégie**

1. **Définition des paramètres** :
   * Montant initial investi
   * Liste des tickers
   * Nombre d’actifs sélectionnés à chaque période
   * Fenêtre rétrospective (période d’analyse de la volatilité passée)
   * Période de reroll (durée pendant laquelle les actifs sélectionnés sont conservés)
   * Date de début et date de fin de l’investissement
2. **Sélection des actifs au temps t** :
   * On regarde la volatilité historique des actifs sur la période **fenêtre rétrospective** avant la date t.
   * On calcule la **volatilité annualisée** pour chaque actif :
   * On sélectionne les **nombre\_actifs** ayant la volatilité la plus faible.

**Limites et Risques**

⚠️ **Dépendance au marché** : La volatilité passée ne garantit pas la stabilité future.

⚠️ **Frais de transaction** : Une réallocation fréquente peut engendrer des coûts élevés.

⚠️ **Potentiel de sous-performance** : En période haussière, cette stratégie peut être moins performante que des stratégies plus agressives.

**Conclusion**

La stratégie **Minimum Variance** est idéale pour les investisseurs cherchant à minimiser le risque tout en maintenant une certaine performance. Elle permet de construire un portefeuille plus stable, mais nécessite une gestion active pour s’adapter aux variations de la volatilité du marché.

A graph with different colored lines

AI-generated content may be incorrect.