

Projet Simulations Management de portefeuilles (PSMP)

Cahier de charges

Contenu du projet

1. Simulation#1

Simuler portefeuille avec 4 titres risqués : suivre modèle du Fichiers Excel « MPRF_PE 2assets» et « MPRF_PE_4A » distribués dans le cours

- Recueillir données pour 4 Titres (actions) risqués, plus de 100 observations avec périodicité de votre choix (jour, semaine, mois...)
- Fournir Feuille de données (de base) avec source (pour validation)
- Tableau de portefeuilles possibles
- Générer FE

2. Simulation#2

Simuler portefeuille avec 4 titres risqués avec bon de trésor (BT) : utiliser les mêmes données de (1) et suivre modèle du Fichiers « Portefeuille 3 titres é BT »

- Générer les différents portefeuilles P0, P1, PT (voir feuille « Scenario1 P0 et P1, Scenario2, Scenario3)
- Générer portefeuille PT & BT et générer CML (feuille « Port_FE)
- Donner le graphe de la FP (voir feuille Fig_FP)

3. Simulation#3

Simuler portefeuille avec 4 titres risqués avec bon de trésor (BT) : utiliser les mêmes données de (1) suivre modèle Fichier « FPT_BT VaR» et voir pour aide « VaR test cas MS et ATT »

- Ploter l'évolution des Prix et des rendements (voir « Evolution_Prix » & « Evolution_Rendement »
- Générer portefeuille PT (voir feuille « Calcul Port »
- Simuler Portefeuille PT & BT (50%,50%)
- Calculer la VaR historique (simulation historique) (voir « VaR Hist Génération Scénari » & « VaR Historique » pour une période (1jour, 1semaine, 1mois) , 10 périodes
- Calculer la VaR paramétrique (analytique) (voir « VaR analytique ») (1jour, 1semaine, 1mois)
- Calculer VaR avec méthode de simulation Monté Carlo (voir documents distribués dans cours générer nombre important de scénaris (500...)

Forme

- Remettre copie papier du projet (avec les 3 simulations)
- Remettre CD copie programme (excutable) Excel (ou autre) utilisé pour les simulations
- Les rapport et CD (application) doivent porter clairement les noms des équipes (à l'exterieur et à l'intérieur)

Date de remise : Jeudi 18 février 2010, 12h, bureau n°34.