



Mars 2018  
Wei GE  
Yi QIAO

# Optimisation d'un portefeuille d'actifs par les réseaux de neurones

Encadrant :

Jean-Marc LE CAILLEC  
Didier GUEROT



**IMT Atlantique**  
Bretagne-Pays de la Loire  
École Mines-Télécom

## Table des matières

<b>1</b>	<b>Introduction</b>	<b>3</b>
1.1	Problématique . . . . .	3
1.2	Présentation de données . . . . .	3
<b>2</b>	<b>Conception et développement de modèle d'apprentissage</b>	<b>4</b>
2.1	Construction de la base d'apprentissage . . . . .	4
2.2	Choix du modèle . . . . .	4
2.3	Préparation des scénarios . . . . .	4
<b>3</b>	<b>Résultats obtenus et analyse</b>	<b>5</b>
3.1	Résultats de différents scénarios . . . . .	5
3.2	Evaluation du modèle . . . . .	5
3.3	Difficultés rencontrées . . . . .	5
<b>4</b>	<b>Prospectives et points à améliorer</b>	<b>6</b>
<b>5</b>	<b>Conclusion</b>	<b>7</b>

# **1 Introduction**

## **1.1 Problématique**

## **1.2 Présentation de données**

## **2 Conception et développement de modèle d'apprentissage**

### **2.1 Construction de la base d'apprentissage**

### **2.2 Choix du modèle**

### **2.3 Préparation des scénarios**

## **3 Résultats obtenus et analyse**

### **3.1 Résultats de différents scénarios**

### **3.2 Evaluation du modèle**

### **3.3 Difficultés rencontrées**

## 4 Perspectives et points à améliorer

## 5 Conclusion