Gruppo 13

Class usage overview

Perché a classi?

Difficile leggere e capire il codice. Lavorare in gruppo non è facile. Si accorpa in un'unica classe tipi fondamentalmente diversi di portafogli (lineare vs derivative). Provano a creare un framework ma viene fuori un po’ un casino. Non c’è generalizzazione dei concetti e dei metodi

ES. il metodo setdates è pubblico e non privato. Viene chiamato nel costruttore e fondamentalmente filtra i nostri returns. Se è pubblico posso chiamarlo con date più stringenti, ma così facendo perdo la possibilità di tornare indietro.

Allocare spazio per le classi richiede tempo e rallenta notevolmente l’esecuzione. Si creano attributi da dentro le classi. Alcuni metodi poi li usano ma non è garantito che esistano. Non c’è error handling mai. Che framework costruisco se non gestico gli errori?

Variabile globale molto sconsigliata, dovrebbe essere un attributo della classe.

Si mischiano metodi per portafogli lineari con derivati, si dovrebbe separare in due classi.

Var non è una proprietà del portafoglio ma fatta su di esso.

Early optimization is a trap! Devil is in the details.

Option è una classe vuota, EUOption è solo un wrapper intorno alle funzioni

Esercizio 0

Usano returns e non log returns. (Noi dobbiamo spiegare perché è sbagliato ed è meglio usare i returns). Using returns pollutes the results!

Valori cannati di conseguenza. Implementazione errata di ES, ma per fortuna la radice non è un problema.

Bella idea mettere anche la Gaussiana sia in VaR che in ES così si riusa anche per la PCA.(poi non la usano….)

Nessuna spiegazione del perché i risultati sono coerenti.

(Nostra interpretazione da aggiungere)

Esercizio1

Ancora log returns

Portfolio value sbagliato

Pesi sbagliati, pesati per share e non per valore per numero di share

Ticker sbagliati, hanno usato dello 0.Il portfolio A non viene mai effettivamente valutato.

Non siamo riusciti a sbuggare, ci sembra corretto come viene fatto il HS

Manca un meno nelle losses.

No commenti

BOOTSTRAP

NO replacement

Ritorni e portafoglio

No commento ai risultati

PC

Sbagliato il meno nella sensibility ma c’è il quadrato e si cancella.

No commento ma osservazion sull’ordine di grandezza corretta.

Valori sbagliati ma consistenti.

Punto 1.2

Ticker giusti e weights giusti

NO fucking comment!!!

If the correct imput (ritorni) the implementation is correct

PUNTO 1.3 PCA

Returns

Procedura corretta

Commento sul numero di componenti da usare carino.