

PROJET

Vous trouverez en pj un fichier avec tous les tickers du MSCI World et les poids des différents titres observés mensuellement. Vous pourrez ainsi reconstituer la performance de l'indice dividendes réinvestis. Vous présenterez d'ailleurs sur une slide le graphique historique avec les principales statistiques.

Les données de cours sont disponibles sur Yahoo Finance à partir de 2007 et jusqu'à fin 2024.

N'oubliez pas de convertir l'ensemble des titres dans la même devise (l'USD ou l'EUR par exemple) afin d'obtenir des résultats cohérents.

Voici les questions du projet :

- 1- Construire un portefeuille long only basé sur le momentum 1 an sur la période 2007-2024. Vous testerez plusieurs typologies de construction (décile / quintile / quartile) et de rebalancements (M / Q) et de sélection (segmentation sectorielle ou pas) et présenterez les résultats en comparant à l'indice de référence (MSCI World) à travers un tableau statistique et un graphique. Vous commenterez les résultats obtenus en indiquant le set-up idéal.
- 2- Mêmes questions pour un portefeuille Long Only basé sur un momentum idiosyncratique.
- 3- Comparaison entre les deux types de momentum sur un même graphique avec un commentaire.
- 4- Mêmes questions que 1- en appliquant un portefeuille Long Only basé sur le momentum 1 mois (mean reverting)
- 5- Mêmes questions que 1- en appliquant un portefeuille Long Only basé sur le momentum idiosyncratique 1 mois (mean reverting)

6- Comparaison entre les deux types de momentum 1 mois sur un même graphique avec un commentaire.

7- Enfin, vous construirez un portefeuille Long Only basé sur le Sharpe ratio (hypothèse de taux = 0%) et vous présenterez les résultats (cf. question 1).

8- Vous pourrez conclure en indiquant la stratégie qui vous paraît la plus pertinente en vous appuyant sur les statistiques (performance, volatilité, permanence de rendement etc...)

Le projet doit se faire par groupe de 3 (ou 2 de façon exceptionnelle) et devra être rendu pour le 30 avril 2025 sous forme de Ppt (idéalement) ou word avec le fichier excel correspondant (l'utilisation de Python est recommandée pour ce projet).