

# Finance Durable Projet

Thierry BÉCHU - Jean JARDEL

Université Paris - Dauphine

Janvier 2025



## ① Projet



# Consignes

Par groupe de 2, à partir du fichier "all\_data.csv" contenant une grande diversité de données financières et extra-financières pour les actifs du MSCI World Developed Markets au 31 décembre 2024, **créez un portefeuille équilibré, performant et avec des caractéristiques extra-financières attractives.**

Le portefeuille devra remplir les critères de l'**Article 9** SFDR. Vous devrez donc trouver un objectif compatible avec l'Article 9 et respectant la position recommandation AMF 2020-03.

Vous êtes libre de la stratégie adoptée et vous pouvez utiliser n'importe quelles données complémentaires pour construire votre portefeuille.

Vous êtes libre du nombre d'actifs sélectionnés et vous devez **proposer une pondération.**

# Rendu

Le rendu devra contenir :

- Une présentation PowerPoint d'environ 10 slides présentant l'objectif du portefeuille, les filtres, les règles de sélection ainsi que les règles de pondération et tout élément que vous jugerez utile pour justifier votre allocation
- Un fichier Excel contenant les actifs sélectionnés ainsi que leur poids dans le portefeuille
- Un fichier Excel contenant l'ensemble des données complémentaires utilisées (si d'autres données ont été utilisées)

Les réponses sont à envoyer **avant le mardi 28 janvier 2025 à 23h59** par mail à :

- [thierry.bechu@kanopy-am.com](mailto:thierry.bechu@kanopy-am.com)
- [jean.jardel@kanopy-am.com](mailto:jean.jardel@kanopy-am.com)

Une note entre -2 et +2 sera appliquée sur la note finale pour chacun des élèves du groupe.