

PROJECT COMMODITIES

Organisation

Travail en groupe de 2 ou 3 élèves-ingénieurs

Objectif

Création d'une stratégie d'investissement sur les matières premières. La stratégie se présente sous la forme d'un indice qui investit sur des mono indices commodity en prenant des expositions long et/ou short.

Exemple de mono-indice (code Bloomberg) BCOMCL Index, BCOMCL3 Index,

Rendu

Une présentation avec 3/4 slides. La présentation doit contenir à minima :

Le rationnel d'investissement (Ex p72 du cours)

Le track avec les indicateurs (ex p74 du cours)

Implémentation en python.

Formule Calcul Indice

$$\frac{ER_t}{ER_{R(t)}} - 1 = \sum_{c=1}^{c=N} CW_{R(t)}^c \left(\frac{UI_t^c}{UI_{R(t)}^c} - 1 \right)$$

t = date de calcul de l'indice

R(t) = date à laquelle le poids du mono-indice a été défini pour la date t

CW(c,R(t)) = poids dans la stratégie du mono c indice C

ER(t) = Stratégie finale

UI(c,t) = valeur du mono indice en t

UI (c, R(t)) = valeur du mono- indice à la date de rebalancing