**Mode Opératoire : Outil Reporting Python**

1. Lancer le code dans le fichier python « Tool\_Management » depuis un interpréteur (Exemple : Spyder de Anaconda).
2. Une fenêtre Tkinter s’ouvre, et veuillez sélectionner 20 actifs depuis le panier d’actifs proposé (situé à gauche de votre fenêtre).
   * Appuyez sur le nom des 20 entreprises qui vous intéressent (surbrillance en bleu lors de la sélection)
   * Appuyez sur « Ajouter »
   * Dans le panier de droite s’affiche votre panier d’actifs sélectionné.
   * Si vous souhaitez supprimer des actifs, veuillez les sélectionner dans le panier de droite, et appuyez sur « Supprimer ».

Une image contenant texte, logiciel, Page web, Icône d’ordinateur

Description générée automatiquement

1. Sélectionner dans le sélectionneur de date la période sur laquelle vous souhaitez réaliser votre reporting.

Une image contenant texte, Police, capture d’écran, blanc

Description générée automatiquement

1. Lorsque votre choix de panier d’actifs est définitif et vos dates de reporting instanciées, appuyez sur « Valider portefeuille ».

Une image contenant texte, Police, capture d’écran, Bleu électrique

Description générée automatiquement

1. Appuyer sur « Générer les données du portefeuille » afin de lancer l’analyse de votre panier d’actifs afin d’obtenir les poids optimaux de chaque actif dans ce dernier, ainsi que sa performance et ses métriques de risques sur la période de reporting.



1. Aller dans l’onglet « Overview et composition du portefeuille » pour obtenir les résultats d’analyses. Vous trouverez également dans l’onglet « Visualisation graphique du portefeuille et son benchmark » le graphique comparant les performances du portefeuille avec le CAC 40.



Une image contenant texte, capture d’écran, logiciel, Page web

Description générée automatiquement

Une image contenant texte, capture d’écran, Tracé, ligne

Description générée automatiquement

1. Si les résultats de l’analyse vous convient, appuyer sur « Générer Powerpoint » afin de générer un reporting au format PPT. Ensuite, appuyez sur « Générer PDF » afin d’obtenir un reporting au format PDF de votre portefeuille.



1. Si les résultats d’analyses de vous convient pas, veuillez réitérer le choix des actifs, et les analyses de gestion de portefeuille via le même processus.

**Remarque :**

* Lorsque vous appuyez sur l’un des boutons, celui-ci va devenir blanc, comme ci-dessous.

****

* Veuillez attendre que le bouton redevienne bleu pour aller à l’étape suivante. Ensuite, la couleur blanche signifie que la tâche est en cours d’exécution.

**Méthode de gestion de portefeuille utilisée :**

* Modèle gestion de portefeuille : Markowitz avec optimisation par simulation de monte-carlo
* Critère choix poids optimaux : Portefeuille qui maximise le ratio de sharpe
* Métriques de risque choisis : Rentabilité moyenne sur la période instanciée, volatilité moyenne sur la période, VaR 99% 10 jours, CVaR 99% 10 jours.
* Méthode calcul valeur du portefeuille : Somme des prix \* poids de chaque actif
  + La valeur calculée de notre portefeuille représente le prix d’une part détenue hors frais de gestion.