

Guide d'utilisation

Table des matières

1.	Fiche user friendly	1
1.1.	Paramétrer les inputs.....	1
1.2.	Visualisation	2
1.3.	Reporting	4
2.	Fiche technique.....	6

1. Fiche user friendly

1.1. Paramétrer les inputs

Le document excel initial est composé d'une unique feuille, nommée « Actif ». Sur celle-ci, il est nécessaire de modifier les deux colonnes « Dates » et « Valeurs de l'actif » avec les valeurs de l'actif récupérées ainsi que leur date.

	A	B	C	D	E	F
1	Dates	Actif				
2	01/01/2017	46.904999			GO	
3	02/01/2017	48.665001				
4	03/01/2017	48.235001				
5	04/01/2017	47.099998				
6	05/01/2017	47.34				
7	06/01/2017	46.205002				
8	07/01/2017	46.389999				
9	08/01/2017	46.395				
10	09/01/2017	45.880001				
11	10/01/2017	47.474998				
12	11/01/2017	46.259998				
13	12/01/2017	45.825001				
14	13/01/2017	45.514999				
15	14/01/2017	45.700001				
16	15/01/2017	45.84				
17	16/01/2017	44.834999				
18	17/01/2017	45.799999				
19						

Actif

Une fois cela fait : appuyer sur GO.

1.2. Visualisation

Deux nouvelles feuilles Excel sont alors créées : « VL » et « Détail » ; un UserForm s'affiche. Les nouvelles feuilles se nomment « VL » et « Détail ».

Sur la première feuille est recensé l'historique des Valeur Liquidatives sur toute la période donnée à l'étape 1 ;

	A	B	C
1	01/01/2017	300	
2	02/01/2017	298.239998	
3	03/01/2017	298.239998	
4	04/01/2017	299.375001	
5	05/01/2017	299.375001	
6	06/01/2017	299.375001	
7	07/01/2017	299.559998	
8	08/01/2017	299.564999	
9	09/01/2017	299.05	
10	10/01/2017	300.644997	
11	11/01/2017	299.429997	
12	12/01/2017	298.995	
13	13/01/2017	298.995	
14	14/01/2017	298.995	
15	15/01/2017	298.855001	
16	16/01/2017	299.860002	
17	17/01/2017	298.895002	
18	18/01/2017	296.915002	
19	19/01/2017	296.915002	
<div><div>< ></div><div>VL</div><div>Detail</div><div>Actif</div></div>			

	A	B	C	D	E	F	
1	Dates	Monétaire	Actif acheté	VL	Actif vendu	Cours de l'actif	
2	01/01/2017	253.095001	0	300	46.904999	46.904999	
3	02/01/2017	298.239998	0	298.239998	0	48.665001	
4	03/01/2017	250.004997	0	298.239998	48.235001	48.235001	
5	04/01/2017	299.375001	0	299.375001	0	47.099998	
6	05/01/2017	299.375001	0	299.375001	0	47.34	
7	06/01/2017	253.169999	46.205002	299.375001	0	46.205002	
8	07/01/2017	253.169999	46.205002	299.559998	0	46.389999	
9	08/01/2017	253.169999	46.205002	299.564999	0	46.395	
10	09/01/2017	253.169999	46.205002	299.05	0	45.880001	
11	10/01/2017	253.169999	46.205002	300.644997	0	47.474998	
12	11/01/2017	253.169999	46.205002	299.429997	0	46.259998	
13	12/01/2017	298.995	0	298.995	0	45.825001	
14	13/01/2017	298.995	0	298.995	0	45.514999	
15	14/01/2017	253.294999	0	298.995	45.700001	45.700001	
16	15/01/2017	253.294999	0	298.855001	45.700001	45.84	
17	16/01/2017	253.294999	0	299.860002	45.700001	44.834999	
18	17/01/2017	253.294999	0	298.895002	45.700001	45.799999	
19	18/01/2017	298.015002	0	298.015002	0	47.770002	

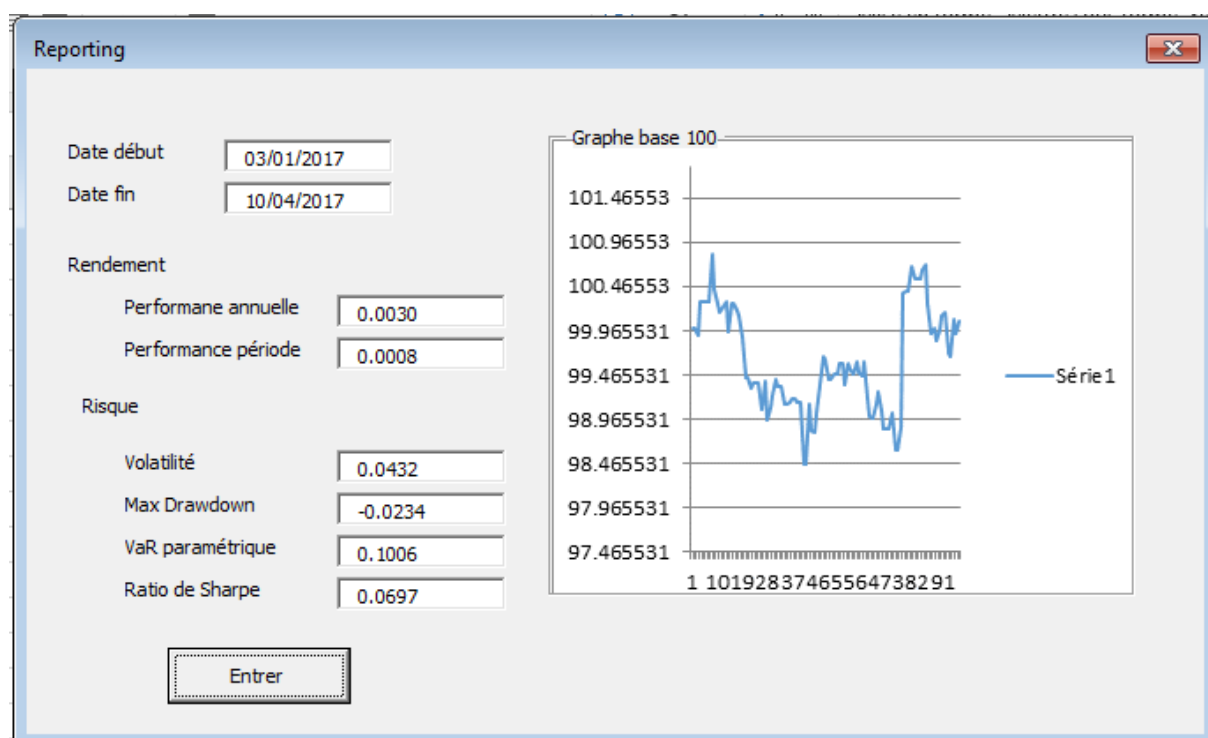
1.3. Reporting

En plus de ces deux feuilles, un UserForm de reporting est créé.

The screenshot shows a Windows-style UserForm titled "Reporting". It features a close button (X) in the top right corner. The form is divided into two main sections. On the left, there are several input fields: "Date début" and "Date fin" (which are highlighted with a red rectangle), "Performane annuelle", "Performance période", "Volatilité", "Max Drawdown", "VaR paramétrique", and "Ratio de Sharpe". Below these fields is a button labeled "Entrer". On the right side, there is a large empty rectangular area labeled "Graphe base 100".

Il est nécessaire d'entrer en paramètres d'entrée la date de début et la date de fin de la période sur laquelle nous souhaitons avoir les informations, puis appuyer sur Entrer. Le format de date est le suivant : jj/MM/AAAA. Si la date présente une erreur, un message d'erreur s'affichera.

Lors de l'appui sur le bouton Entrer, différents indicateurs de rendements/risques sont alors affichés dans leur case respective, et un graphique base 100 de la Valeur Liquidative est affiché dans le cadre à droite du UserForm.

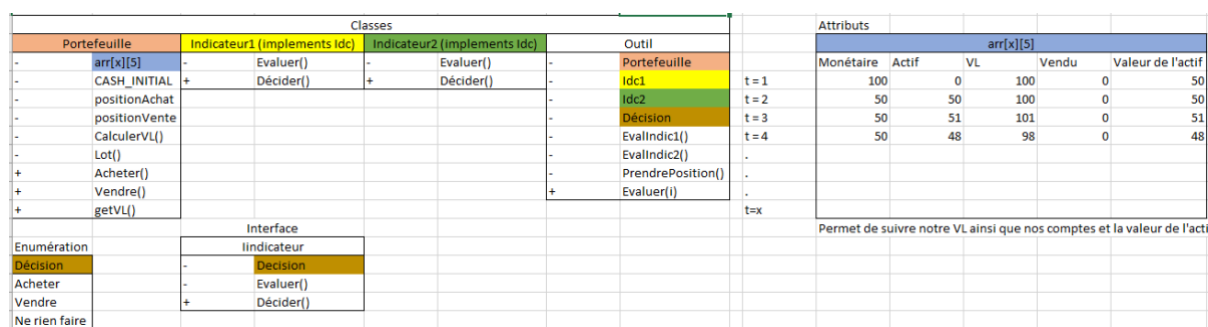


(NB : Les indicateurs ci-dessus sont représentatifs de données prises au hasard et d'indicateurs aléatoires.)

2. Fiche technique

Afin de rendre l'outil facilement modifiable, nous l'avons séparé en un certain nombre de classes.

Ci-dessous le diagramme de classe.



Ainsi, il est aisé de modifier le fonctionnement des indicateurs en modifiant directement le code dans l'une des deux classes, et il est aisé de modifier la somme de cash initial, en modifiant l'attribut privé de la classe Portefeuille.

De plus, la classe Reporting ci-dessous permet de changer la méthode de calcul des indicateurs de reporting. Si nous avons le besoin, dans le futur, de modifier la façon de calculer la Value at Risk, il suffit de modifier la fonction VaR() directement dans le code.

Reporting	
-	arr_VL
+	Vol()
+	MaxDD()
+	VarParametrique()
+	RatioSharpe()
+	PerfAnnuelle()