Strategy

# Contraintes :

## Données d’entrée :

* Fournir les historiques de données
* Un paramètre peut soit contenir une seule valeur, ou un historique.
* Pas sur : Un dictionnaire contenant les **clés,** faisant référence aux paramètres ayant un historique, et dont les **valeurs** font références au fichier contenant l’historique devra être fourni.

*Exemple* : {Perf\_titres : perfs\_titres.csv, Betas : beta.csv, Perf\_Benchmark : perfs\_bench.csv}.

* Les historiques devront forcer 5 jours par semaines et un lissage prenant la dernière donnée disponible.
* La première ligne contiendra les intitulés.
* Fournir le fichier des univers comprenant la date en colonne A et la liste des tickers dans la colonne B.

## Algorithme de sélection de titres :

* Possibilité d’exclusion de certaines données si l’historique n’est pas suffisant. Il faut donc définir un **seuil de tolérance** et si l’absence de cette donnée est **suffisante** pour **exclure le titre**.
* Classe de gestion des dates
* Classe de simulation par « pas » à partir du précédent prtf.
* Possibilité de fournir des portefeuilles (en argument) pour certaines dates :
  + Fichier csv devant être conforme au format des **Output**:
* Doit inclure le back test.
* Output (voir Bloomberg):
  + Doit contenir
    - Colonne A : La date du portefeuille
    - Colonne B : Les titres (Tickers)
    - Colonne C : Les poids ou quantités