Selection

# Contraintes :

## Données d’entrée :

* Fournir les historiques de données
* 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

# Utilisation :

La sélection de titre se compose de 6 modules :

* Selection.py : Algorithme central
* Model\_Calcs.py : module de traitement des données et de composition des portefeuilles.
* PlotPrtf.py : module de calcul de performance et de visualisation graphique
* DateCalc.py : module de gestion des dates
* Utils.py : diverses fonctionnalités
* Backtest.py : module de backtest de modèle

## Principe :

**Périodicité** : mois

**Nombre de période** : 6

**Type de pas** : mois

**Nombre de pas** : 1

Début de la **période de calcul** (début juin 2019)

Calcul du PRTF de janvier 2020

Calcul du PRTF de décembre 2019