

NOM :

PRENOM :

DATE :

1. Combien de données figurent sur la feuille 1 ? . . . Pourquoi ce nombre est-il inférieur au nombre de jours des mois de janvier à mars ? . . .
2. Quelle valeur obtenez-vous en B6 ? . . .
3. Quelle valeur obtenez-vous en B87 ? . . .
4. Quelle différence observez-vous entre les deux courbes représentées ? . . .
5. Combien y a-t-il de « franchissement à la hausse » et combien y a-t-il de « franchissement à la baisse » ? . . .  
 Observez que notre échantillon commence par un franchissement à la hausse (achat) et que le cours n'est jamais égal au lissé : on pourra donc tester la présence d'un franchissement par la présence de deux écarts cours-lissée de signe opposé.
6. Dans l'échantillon considéré, termine-t-on sur un achat (« prise de position ») ou sur une vente (« débouclage de position ») ? .
7. Quelle est la valeur de la première cellule non nulle en colonne E ? . . .  
 Quels sont les Profits et Pertes réalisés par cette stratégie sur cet échantillon (faire effectuer le calcul en E88) ? . . .
8. Vérifiez que vous obtenez bien en F87 la réponse que vous avez obtenue à la question précédente.
9. Quelle est la variation de valeur de l'indice pour la période considérée ? . . .  
 (faites faire le calcul a excel, en cellule A89 par exemple)
10. A quoi correspondent les plages agitées et les plages constantes du P&L ?
11. Qu'obtenez-vous pour Moyenne :. . . et pour Ecart-type :. . . ?
12. Quelles valeurs pour Moyenne et Ecart-type obtenez-vous pour des lissages sur 4, 3, et 2 jours. Quel est le P&L final dans chaque cas ?

| Nb pas de lissage | P&L | Moyenne | Ecart-type |
|-------------------|-----|---------|------------|
| 4                 |     |         |            |
| 3                 |     |         |            |
| 2                 |     |         |            |
| 1 (Buy and hold)  |     |         |            |