

DESCRIPTIF DES FICHIERS

NB : les temps de calcul indiqués ont été obtenus sur un PC équipé d'un processeur AMD cadencé à 550 MhZ.

1. Calcul de statistiques élémentaires
 - Feuille de calcul : **Stats Elémentaires.xls**, taille 607 Ko
 - Temps de calcul : 0,26 secondes
2. Estimation de la densité des taux de rentabilité par la méthode du noyau
 - Feuille de calcul : **Noyau.xls**, taille 969 Ko
 - Temps de calcul : 29 minutes et 42 secondes
3. Test du filtre d'Alexander
 - Feuille de calcul : **Alexander.xls**, taille 616 Ko
 - Temps de calcul : 3 minutes et 41 secondes
4. Test de la méthode des moyennes mobiles
 - Feuille de calcul : **Mmobiles.xls**, taille 638 Ko
 - Temps de calcul : 4 minutes et 3 secondes
5. Diversification naïve
 - Feuille de calcul : **Diversification naïve.xls**, taille 1444 Ko
 - Temps de calcul : 6 secondes
6. Ensemble faisable
 - Feuille de calcul : **Ensemble faisable.xls**, taille 1457 Ko
 - Temps de calcul version standard (Module « Faisable ») : 54 secondes
 - Temps de calcul version alternative (Module « Variante ») : 24 secondes
7. Frontière efficiente – version utilisant le solveur
 - Feuille de calcul : **Frontière efficiente – version solver.xls**, taille 83 Ko
 - Temps de calcul portefeuilles enveloppe (Module « Pf_Enveloppe ») : 2 minutes
 - Temps de calcul de la frontière efficiente (Module « Frontière_Efficiente ») : 4 minutes et 52 secondes
8. Frontière efficiente – par résolution partielle du Feuille de calculs d'optimisation
 - Feuille de calcul : **Frontière Efficiente – résolution optimisation.xls**, taille 1472 Ko
 - Temps de calcul : 1 minute et 34 secondes
9. Modèle de marché standard
 - Feuille de calcul : **Modèle marché standard.xls**, taille 836 Ko

- Temps de calcul : 1 minute et 1 seconde
10. Modèle de marché – version Scholes-Williams
- Feuille de calcul : **Modèle marché Scholes-Williams**, taille 806 Ko
 - Temps de calcul : 1 minute et 2 secondes
11. Evaluation d'options
- Feuille de calcul : **Options 1.xls**, taille 53 Ko – Version du livre
 - Feuille de calcul : **Options 2.xls**, taille 68 Ko – Version permettant de pricer toutes les combinaisons offertes par la UserForm