

Rapport projet MOPSI : Calibration en finance, Mélanges de modèles de Black-Scholes

Mohammed Amine KHELDOUNI

19 janvier 2017

Table des matières

1	Préliminaires	2
2	Optimisation des prix du marché	2
2.1	Formule de Black-Scholes	2
2.2	Minimisation des résidus	2
3	Volatilité implicite	2
3.1	Inversion de la formule de Black-Scholes	2
3.2	Smiles de volatilité	2

1 Préliminaires

2 Optimisation des prix du marché

2.1 Formule de Black-Scholes

2.2 Minimisation des résidus

3 Volatilité implicite

3.1 Inversion de la formule de Black-Scholes

3.2 Smiles de volatilité