

Compte rendu de réunion - Projet de fin d'étude

Présents :

- *Encadrant de projet : M. MARIE*
- *Mme BENHEBRI*
- *Mme CAZENAVE*

Ordre du jour : *Démarrage du projet de fin d'étude sur l'estimation du modèle de Black-Scholes.*

La réunion de ce jour nous a permis de scinder notre sujet en quatre parties :

Trois parties mathématiques indépendantes et une partie informatique.

Les parties mathématiques sont en lien avec notre programme de cette année de calculs stochastiques. Cependant nous n'avons pas encore abordé les éléments de cours pour pouvoir les traiter.

Nous pouvons commencer la quatrième partie car le sujet nous fournit les formules que nous pouvons implémenter. Nous avons choisi de commencer par une architecture simple qui permettrait d'entrer les paramètres puis d'afficher le graphique et de calculer les erreurs. Puis nous rajouterons des options et des graphiques supplémentaires.

Le compte-rendu sera réalisé en LaTeX, un langage permettant de faciliter la rédaction de textes et de formules.