

Compte rendu de réunion - Projet de fin d'étude

Présents :

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

Ordre du jour : *Deuxième réunion de suivi de projet de fin d'études sur l'estimation du modèle de Black-Scholes.*

Durant cette réunion, nous avons présenté l'interface de notre application.

Nous l'avons réalisé en C# sur l'environnement de développement Visual Studio.

Celle ci est constituée de 4 pages :

- Un menu ;
- Une page d'aide ;
- Une page de saisie des paramètres ;
- Une page de modélisations des graphiques et d'affichage des erreurs.

Nous avons défini les intervalles de définition de chaque paramètre ainsi que le pourcentage auquel une erreur est acceptable ou non, indispensables pour notre application.

Soient :

- n est un entier positif représentant le nombre d'éléments dans la subdivision/taille de l'échantillon.
- T est un réel positif non nul, c'est l'horizon en temps.
- S_0 est strictement positif, c'est le point de départ de diffusion / le prix initial de l'actif (asset).
- σ est un positif, il représente la volatilité / le niveau d'instabilité en finance.
- μ représente le drift.

Pour avoir de bonnes estimations, il faudra que l'on saisisse des n et T grands : beaucoup de points sur une grande distance.

Une erreur est acceptable à +/- 5%.