

Compte rendu de réunion - Projet de fin d'études

Présents :

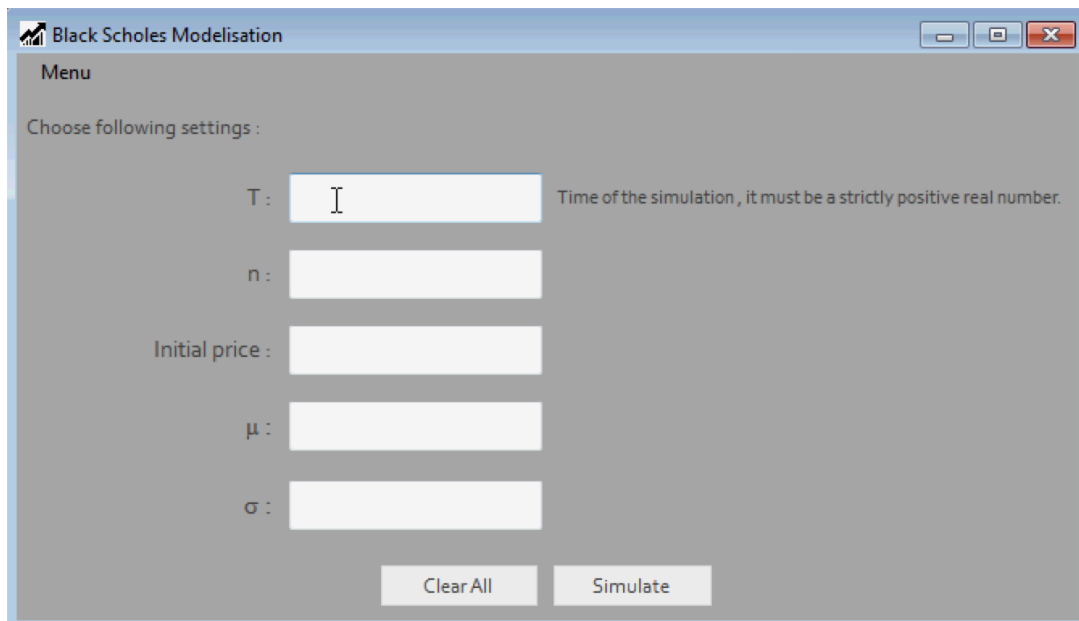
- Encadrant de projet : M. MARIE
- Mme BENHEBRI
- Mme CAZENAVE

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

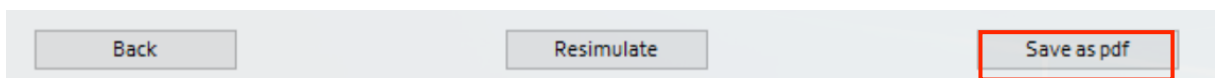
Durant cette réunion nous avons présenté les évolutions de notre application.

En effet, les modifications suivantes ont été apportées :

- La page "Help" a été supprimée. Les informations qu'elle contenait ont été ajoutées à la page de la « theoretical simulation » où l'utilisateur renseigne les paramètres. Lorsque l'utilisateur survole l'emplacement d'un paramètre, les renseignements concernant celui-ci s'affichent. Cela permet une meilleure ergonomie pour l'utilisateur.



- Ajout de la fonction "Save as PDF" permettant de sauvegarder une simulation au format PDF. Depuis la page de simulation des graphiques, l'utilisateur peut sauvegarder les trois simulations dans un même rapport via ce bouton.

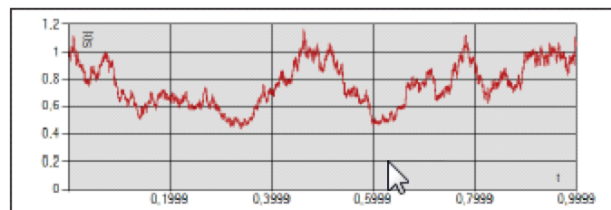


Lorsque l'utilisateur clique sur ce dernier, un explorateur Windows s'affiche pour lui permettre de choisir où enregistrer le rapport ainsi que de renseigner son nom. L'enregistrement est fait lorsqu'une fenêtre d'alerte indique « file saved ». Tous les graphiques sont alors sauvegardés en PDF sous la forme suivante :

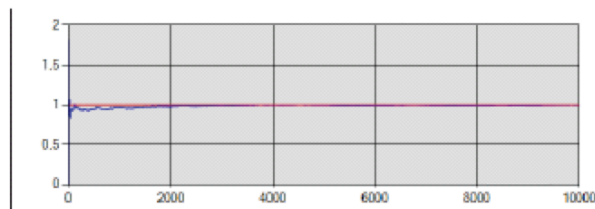
BLACK-SCHOLES MODELIZATION OF 20/01/2017

Maturity	Observations	Initial condition	Risk-free rate	Volatility	Drift
1	10000	1	0,5	1	1

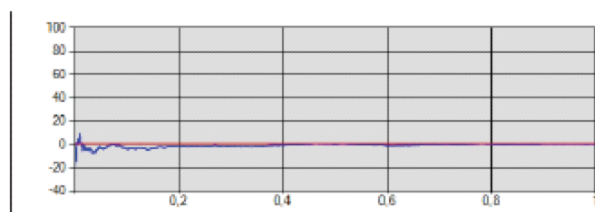
Black-Scholes Simulation



Volatility Estimation



Risk-free rate Estimation



Dans le titre, la date est celle du jour de l'enregistrement. Le tableau au début du rapport indique les valeurs de tous les paramètres utilisés pour ces simulations. Enfin, chaque graphique peut être distingué par son titre.

Nous avons également établi que la suite de notre partie mathématique du projet consistera à l'étude d'une publication de Mme Coutin, portant sur la statistique des processus et l'application à la finance.