

Compte rendu de réunion - Projet de fin d'étude

Présents :

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

Ordre du jour : Cinquième réunion de suivie de projet de fin d'étude sur l'estimation du modèle de Black-Scholes.

Lors de cette réunion de projet, nous avons corrigé la façon de calculer les erreurs que nous devons mettre en évidence afin de représenter la différence entre la théorie et la réalité.

Précédemment, nous obtenions l'erreur grâce à un pourcentage pour établir la qualité de l'estimateur. Cependant, nous avons donc déterminé que la différence en valeur absolue entre la valeur théorique et valeur observée sera plus pertinente et montrera bien que l'estimateur converge.

Pour le paramètre de dérive cela donnera : $|\theta - \hat{\theta}_n|$.

Et pour la volatilité: $|\sigma - \hat{\sigma}_n|$.

Il faudra faire apparaître ces équations dans la documentation de l'application afin que l'utilisateur puisse comprendre la méthode utilisée.

On établit alors arbitrairement que l'estimation est bonne quand elle est à plus ou moins 0,05 de la valeur entrée en paramètres donc comprise dans l'intervalle suivant : [valeur théorique - 0,05 ; valeur théorique + 0,05].

Il est demandé également d'afficher le n à partir duquel le tracé est dans la marge d'erreur. L'utilisateur pourrait entrer en paramètre la précision qu'il souhaite obtenir.

Nous avons également fait valider le tracé des deux dernières courbes ainsi que l'ergonomie de l'application.



Black Scholes Modelisation

Menu

Choose following settings :

T :

n :

S0 :

μ :

σ :

Simulate

[Help](#)

