

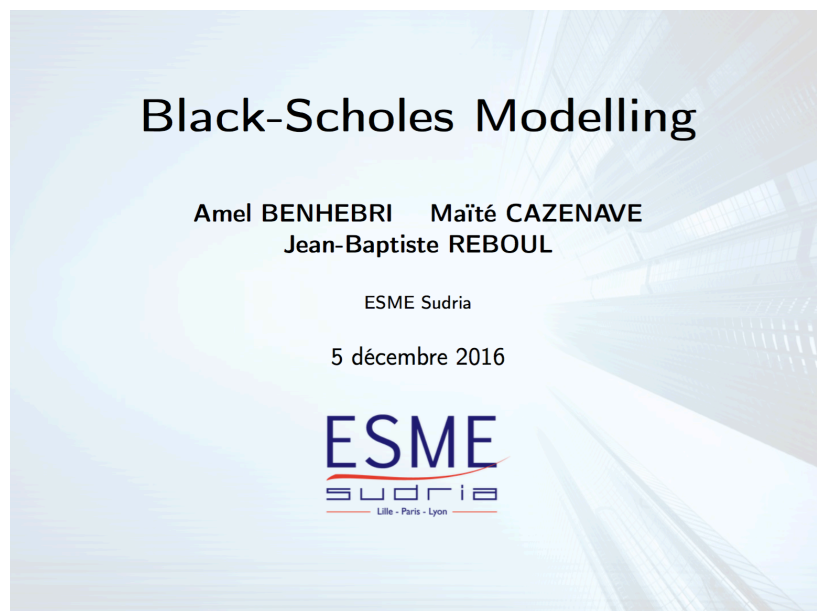
Compte rendu de réunion - Projet de fin d'étude

Présents :

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

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

Durant la réunion, nous avons présenté notre préparation des diapositives de notre soutenance de mi-parcours que nous avons réalisé avec Beamer.



Nous avons pu procéder à la modification de certaines informations.

Il est important de bien faire la différence entre notre cas définissant les actifs aux termes relatifs aux options. Par exemple, « payment date » est une spécificité du marché d'options.

Nous avons défini que le drift est la composante déterministe tendancielle du processus :

- Drift: parameter controls the deterministic component of the motion.
- Volatility: random component of the stochastic process.

L'estimation de la volatilité s'explique par la méthode des moindres carrés, et l'estimation du drift par la méthode du théorème ergodique. Nous essaierons de définir ces deux méthodes lors de la prochaine réunion.

Nous avons également présenté l'ajout de la fonctionnalité « zoom » de notre application. Cette fonction permet d'agrandir une partie de graphique obtenu après simulation.