

Cahier des charges client

Fonctionnalités

- Après avoir choisi :
 - les caractéristiques de l'option,
 - les dates de début et de fin de mon test,
 - si les données sont simulées ou historiques,
 - la fenêtre d'estimation des paramètres,

je veux obtenir en sortie le payoff de l'option et la valeur du portefeuille de couverture correspondant¹.

- Après avoir fourni les mêmes entrées que précédemment, je veux pouvoir comparer à chaque date la valeur de mon portefeuille de couverture et le prix théorique de mon option.
- Je veux pouvoir spécifier les dates de début et de fin, et choisir si les données sont simulées ou historiques et spécifier la fenêtre d'estimation directement dans l'interface.
- Je veux pouvoir donner en amont les caractéristiques de plusieurs options et choisir dans l'interface l'option à tester.
- Je veux pouvoir spécifier la fréquence de rebalancement directement dans l'interface.
- Je veux pouvoir spécifier les caractéristiques des options à tester dans un fichier qui sera chargé au lancement de l'application.
- Je veux pouvoir ajouter/supprimer des options directement dans l'application.

Remarques générales

- L'ergonomie de l'application sera un point important.
- Toute erreur doit être rattrapée.

¹ Aucune précision n'est donnée sur la façon dont les paramètres sont fournis, ils peuvent donc être codés en dur dans l'application.