

Titre.

Thierry BAZIER-MATTE Vincent JOHAL

Le 16 décembre 2016

1 Introduction.

2 Calibration de la courbe zéro coupon.

- Etapes de la construction de la courbe ZC.
- Tableau des parametres
- Tableau des erreurs de la courbe
- Figure de la courbe ZC avec points empiriques
- Figure de la courbe ZC NS et de la courbe forward NS

3 Calibration des prix caps.

- Figure des prix caps avec le prix black.
- Figures de la vol brutes et de la vol impliquée par le processus

4 Processus CIR++.

- Figures des processus dans le temps.
- Positivité des taux et bornes employées; justification

5 Evaluation des MBS.

- Methodologie
- Justification theorique en referant aux equation de Veronesi;
- Insertion d'un tableau similaire a celui de la page 299;
- Tableau des resultats et des statistiques appropriees (Deviation standard, kurtose, etc.)
- Figures de la distribution et justification theorique
- Flux financiers des IO et des PO dans le temps (voir Fig. 12.3 p. 448 Veronesi).

6 Evaluation de la durée.

- Justification theorique (pourquoi le δ).
- Tableau des resultats et methodologie

7 Conclusion.

Ceci est un test.

Une couleur foncée.