

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

## **6 Evaluation de la durée.**

- Justification theorique (pourquoi le  $\delta$ ).
- Tableau des resultats et methodologie

## **7 Conclusion.**

Une couleur foncée.