

```
Help
#ifndef _SVJ_H_
#define _SVJ_H_

#include "optype.h"
#include "math/integral.h"

typedef struct SVJPARAMS
{

    /* phi = 1 pour un call et -1 pour un put*/
    double phi;

    /* si type_f = 1 alors utiliser la formule type BS avec
       les 2 integrales
       et type_f = 2 alors utiliser la formule avec une seul
       e integrale.*/
    int type_f;

    /* les parametres de l'option*/
    double St0,K,T,r,divid;

    /* les parametres pour la volatlite stochastique
       si heston = 0, alors volatlite constante = sqrt(V0)
       sinon modele de Heston.*/
    int heston;
    double kappa,theta,sigmav,rho,V0;

    /* les parametres du saut
       si merton = 0, alors pas de saut, sinon sauts d'
       intensite lambda
       et de type log-normal.*/
    int merton;
    double lambda,m0,v;

}
SVJPARAMS;

int calc_price_svj(SVJPARAMS *svj,double *ptprice, double *
    ptdelta);
```

#endif

References