

[Source](#) | [Model](#) | [Option](#)
| [Model_Option](#) | [Help on mc methods](#) | [Archived Tests](#)

mc_lionsregnier

Input parameters:

- Number of iterations N
- Generator_Type
- Number of Exercise Date *exercise_date_number*

Output parameters:

- Price P
- Delta δ

Description:

Computation of Bermudan Option Price with the Lions-Regnier algorithm .
[1]. [Lions-Regnier Method](#)

References

- [1] REGNIER H. LIONS P.L. Calcul du prix et des sensibilites d'une option americaine par une methode de monte-carlo. Technical report, Preprint, 2000. 1