mc_lionsregnier2d

Input parameters:

- Number of iterations N
- Generator_Type
- Number of Exercise Date $exercise\_date\_number$

Output parameters:

- Price P
- Delta1 $delta1$
- Delta2 $delta2$

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