

Finančná matematika – 7. cvičenie

7.1. Implicitná schéma pre európsku call opciu:

Nájdite numerické riešenie pre európsku call opciu pomocou transformácie riešenia rovnice vedenia tepla a porovnajte ho s presným riešením. Aká voľba parametra θ sa vám zdá najvhodnejšia a prečo?

7.2. Implicitná schéma pre európsku put opciu:

Nájdite numerické riešenie pre európsku put opciu pomocou transformácie riešenia rovnice vedenia tepla a porovnajte ho s presným riešením. Aká voľba parametra θ sa vám zdá najvhodnejšia a prečo?