

## Finančná matematika – 8. cvičenie

### 8.1. L2 chyba numerického riešenia:

Vypíšte L2 chybu numerického riešenia pre zjemňujúcu sa sieť pre  $\theta = 0$  (explicitná schéma),  $\theta = 0,5$  (Crankova-Nicholsonovej schéma) a  $\theta = 1$  (implicitná schéma).

### 8.2. Optimálna hodnota parametra $\theta$ :

Skúste nájsť optimálnu hodnotu parametra  $\theta$  pre konkrétnu voľbu ostatných parametrov modelu.