

Finančná matematika – 10. cvičenie

10.1. Nájdenie optimálnej ceny americkej call opcie pomocou PSOR algoritmu:

Riešte problém oceňovania americkej call opcie prevedením na rovnicu vedenia tepla ako problém časovo závislého problému prekážky pomocou PSOR algoritmu. Výsledok vizualizujte.

10.2. Nájdenie optimálnej ceny americkej put opcie pomocou PSOR algoritmu:

Riešte problém oceňovania americkej put opcie prevedením na rovnicu vedenia tepla ako problém časovo závislého problému prekážky pomocou PSOR algoritmu. Výsledok vizualizujte.