

Temat projektu: Porównanie schematów Eulera-Maruyamy oraz Milsteina dla modelu GBM (Geometric Brownian motion) do predykcji cen akcji.

Autor: Jędrzej Sarna

Początkowo kluczowe jest zdefiniowanie modelu GBM. Następnie należy zebrać dane historyczne dotyczące cen akcji oraz na ich podstawie przeprowadzić estymację parametrów dla modelu. Kolejnym krokiem będzie przygotowanie symulacji, zatem kodu, który będzie generował trajektorie dla obu schematów numerycznych. Finalnie, należy wykonać symulacje i na ich podstawie dokonać analizy wyników, porównać dokładność prognozowania cen akcji, stabilność numeryczną czy też czas obliczeń.