

二項期權定價模型

輸入： S, u, d, X, r, n

計算各狀況現貨價格



put

$\text{Max}(0, X - S)$

call

$\text{Max}(0, S - X)$

計算各狀況買權價格

Backward induction
依序回推上一期

得到選擇權期出定價