

POLITECNICO DI MILANO
Corso di Laurea Magistrale di Ingegneria Matematica
Facoltà di Ingegneria dei Sistemi



Progetto di Programmazione Avanzata per il
Calcolo Scientifico:

**Option Pricing per modelli
Exponential-Lèvy in 1d e 2d.**

Nahuel Foresta, matr. 798775
Giorgio G. Re, matr. 799260

Anno Accademico 2012-2013

Indice

1	Modello di Black & Scholes	4
---	----------------------------	---

Introduzione

Capitolo 1

Modello di Black & Scholes