

C++ プログラミング Homework 2

2017 年 12 月 1 日

Problems

1. UTEuropeanOptionSABR.cpp の preliminaryCalculations() をインプリすることで、premium(UT_CallPut callPut), delta(UT_CallPut callPut), vega(UT_CallPut callPut) が正しく計算されるようにせよ。gamma と theta はこの限りではない (トライしたい人は大歓迎)。ATM のケース ($F=K$) もきちんとして動くようにせよ。クラスで言ったように採点は premium だけ考慮する。
2. void UTEuropeanOptionSABR::preliminaryCalculations() にある
if (myExpansionType == UT_LOGNORMAL)
{
}
else
{
}
を switch 分を使って記述し直せ。

SABR の参考論文

SABR を復習したい人は次の論文はいかがでしょう？

1. Classic では、

<http://www.math.ku.dk/~rolf/SABR.pdf>

2. Class で行ったものと論文です。

http://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=1980726