В файле представлен алгоритм оценки worst-off опциона корзиной из двух и более активов Методом Монте-Карло

* Алгоритм подтягивает данные из Yahoo-Finance через API Активы указать списком строк в строку 110
* Дату T0 указать в формате date1 = '2023-09-01'
* Дату T1 указать в формате date2 = '2024-03-01'
* Vol\_spread указать в строке 120 в определении функции

Изображение выглядит как текст, Шрифт, снимок экрана, линия

Содержимое, созданное искусственным интеллектом, может быть неверным.В модели Блэка-Шоулза цена базового актива в реальном мире S(t) следует геометрическому броуновскому движению. Изображение выглядит как текст, Шрифт, снимок экрана, белый

Содержимое, созданное искусственным интеллектом, может быть неверным.

Модель использует данную формулу для расчета 100 тысяч различных вариантов распределения цен, базируясь на средней волатильности актива за прошлый год, а также на bid и offer волатильности.   
**Итоговым результатом оценки является матрица с расчетом необходимых для формулы переменных (forward rates, div-yield, sigma) и 3 варианта цен, в зависимости от типа волатильности.**