

財務工程 HOMEWORK 5-學習歷程

張家瑞 R08323043

第 5 次作業我覺得比前兩次作業困難不少，困難的地方在於每次計算出來的答案皆不相同，無法確認自己的程式碼是否正確。還好老師有提供 QuantLib 的範例，讓我們有依據可以跟著做。使用 Hull White Term Structure 模擬出 Short rate 在套入 GBM 中我也遇到不少問題，因為我一開始不知的 QuantLib 計算出來的形式，後來一步一步觀察發現 QuantLib 會生產出二維 list，重新設計後才獲得解決。透過無風險利率折現找出 put price 和 call price 比較沒有問題。

這次的作業需要花較之前更多時間思考，讓我學習到更多自己對程式碼不熟的部分，是很實用的一次作業。