

財務工程 HOMEWORK 5-流程圖

張家瑞 R08323043

插入套件和 QuantLib，輸入變數



使用 QuantLib 套件，計算 Hull White Term Structure 模擬
出來的 Short rate



將 Short rate 套入 GBM 中，模擬出股價，並且計算 $t=0$ 的現值



將履約價減去價格，若為負則設為 0，計算出 call price



將價格減去履約價，若為負則設為 0，計算出 put price



顯示 Put Price 與 Call Price



完成