

DATE: 05/12/20

輸入基本參數

導入 Hull-White Model

產出圖表

Short Rate Simulation

輸入初始股價
及波動率

導入幾何布朗運動函式

產出圖表

股價波動模擬

輸入 strike price
risk free rate

計算模擬路徑之
maturity 股價

計算平均選擇權
價格及折現

產出

Call price & Put price