

---

*Задача 1.* Найти стоимость вечного американского пут-опциона:

$$P(s) = \sup_{\tau \in \mathcal{T}} \mathbb{E} e^{-r\tau} (K - S(\tau))$$

где супремум берётся по всем марковским моментам  $\mathcal{T}$ .