[BAF645] 파생상품 거래전략 Pre-Term project

강지민 김성결 반유정 유상빈 이선우

1. 주가 path 생성

어떠한 t 시점에서 t+1 시점의 기초자산 가격은 drift term인 와 diffusion term인 의 합을 자연 상수의 지수로 두어 계산할 수 있습니다. 즉,

2. 헤징 주기에 따른 performance 비교

3. Additional analysis