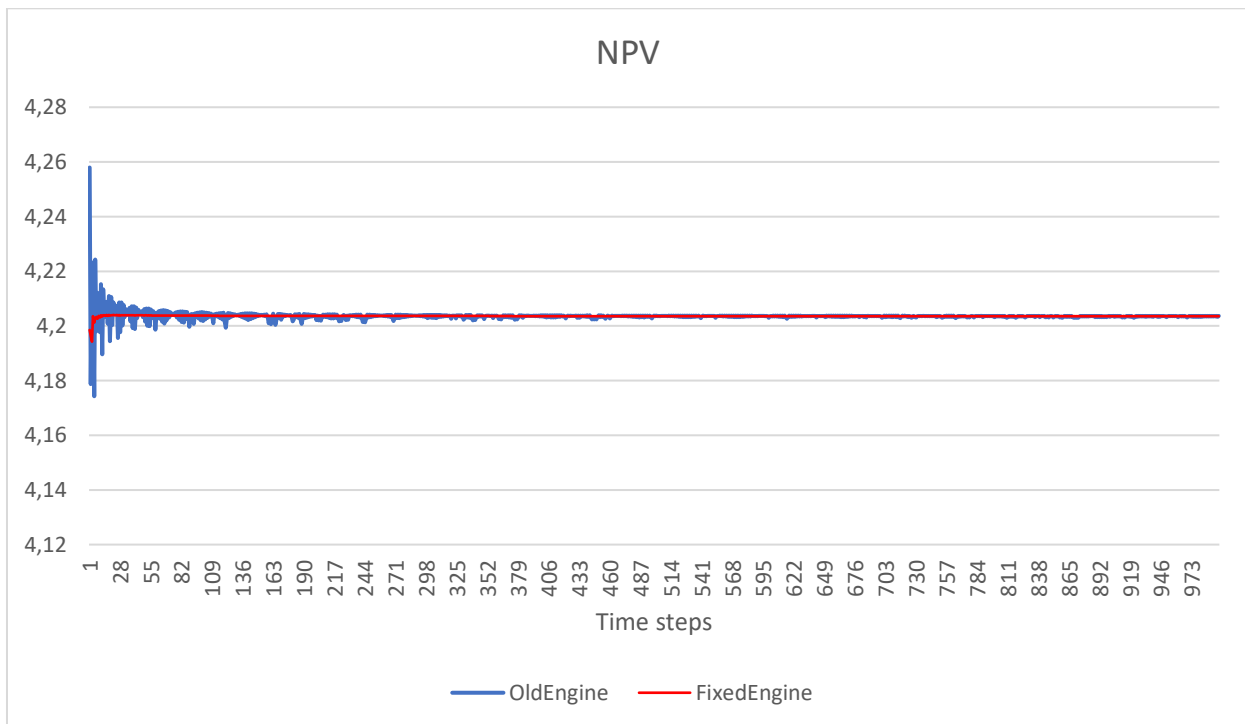
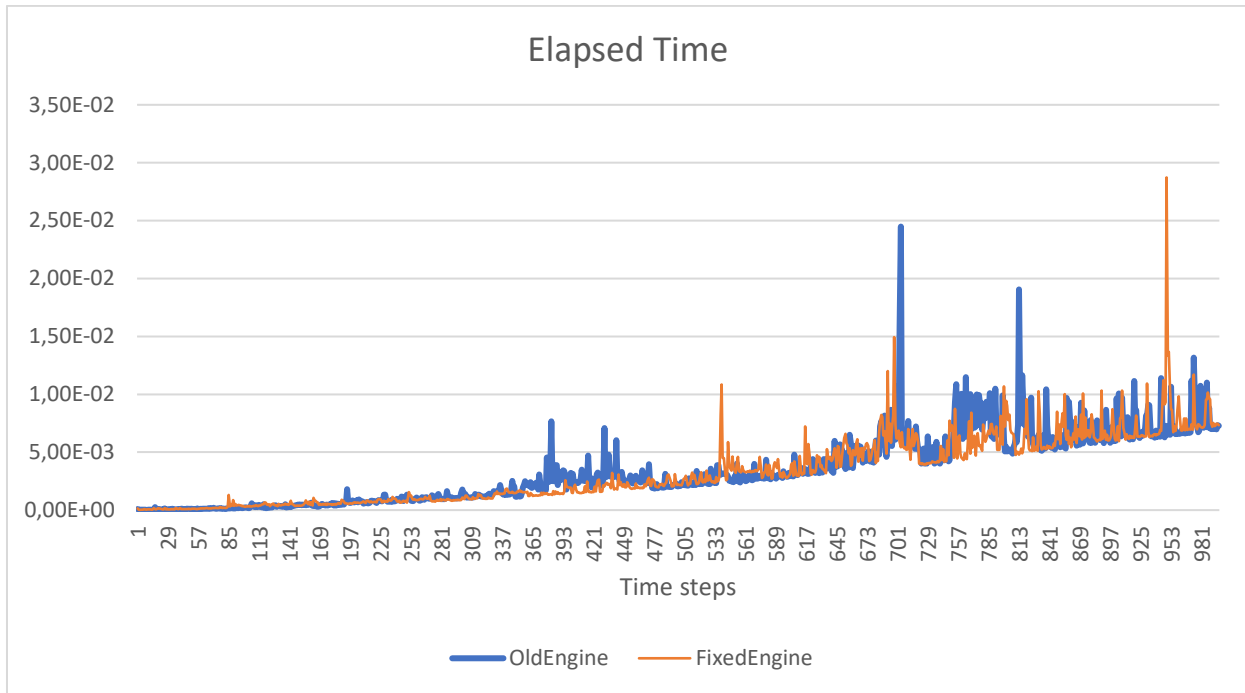


## Résultats Projet 4 Quantlib

Nous avons pris l'exemple du pricing d'un put à la date du 24/02/2022, arrivant à maturité le 24/05/2022 dont le sous-jacent vaut 36\$ avec une volatilité de 20%, un risk free rate de 1% et un strike à 40\$.

Les résultats que nous obtenons après modification de l'engine :



On observe que la NPV de la nouvelle engine converge beaucoup plus rapidement et que le temps de calcul pour chaque time step est du même ordre que celui de l'ancienne engine.