

課題 7

2016/12/08

- (I) 多期間二項モデルの下でアメリカン・プット・オプション価格を求めよ。ただし、 $r = 0.02$ 、 $u = 0.1$ 、 $S_0 = 100$ 、 $T = 1$ 、 $\Delta t = 0.02$ 、 $K = 110$ とし、下方推移の幅 d は $1 + d = 1/(1 + u)$ とする。
- (II) 多期間三項モデルの下でアメリカン・プット・オプション価格を求めよ。ただし、 $r = 0.02$ 、 $\sigma = 0.1$ 、 $S_0 = 100$ 、 $T = 1$ 、 $\Delta t = 0.02$ 、 $K = 110$ とする。