

課題 11

2016/1/20

- (I) 陽的有限差分法による BS 偏微分方程式の近似解法を用いて，ヨーロピアン・プット・オプション価格を求めるプログラムを作り，BS 式による価格と比較して，近似精度を確かめよ．
- (II) 陽的有限差分法による BS 偏微分方程式の近似解法を用いて，アメリカン・プット・オプション価格を求めるプログラムを作せよ．
- (III) 陰的有限差分法による BS 偏微分方程式の近似解法を用いて，ヨーロピアン・プット・オプション価格を求めるプログラムを作り，BS 式による価格と比較して，近似精度を確かめよ．
- (IV) 陰的有限差分法による BS 偏微分方程式の近似解法を用いて，アメリカン・プット・オプション価格を求めるプログラムを作せよ．