

課題 7

2015/11/26

- (II) 多期間二項モデルの下でヨーロッパン・コール・オプション価格を求めよ。ただし、 $r = 0.02$, $u = 0.1$, $S_0 = 100$ とし、下方推移の幅 d は $1 + d = 1/(1 + u)$ とする。また、 $T = 1$, $\Delta t = 0.02$, $K = 110$ とする。
- (II) 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。
- (III) 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。