



Matematica Finanziaria 1 - (MF1)
Esercitazione N.9 - a.a. 2004/2005

1. Implementare un codice in Matlab per il calcolo del premio di opzioni put in stile americano secondo il modello CRR, ricavando inoltre un'espressione per il Δ delle opzioni in funzione dei parametri del modello e del numero di periodi N .

2. Estendere il precedente algoritmo al caso in cui il tasso effettivo R non è più costante ma variabile nel tempo secondo la seguente legge deterministica:

$$R_n = R_{n-1} + 0.02 * \Delta_t,$$

essendo $\Delta_t = T/N$.