

1. počítačové cvičení

1. Napište program, který vykreslí trajektorii standardního WP.
2. Napište program, který a) vykreslí zadaný počet trajektorií WP s parametry μ a σ , b) vykreslí zadaný počet trajektorií geometrického WP s parametry μ a σ .
3. Napište program, který vykreslí trajektorii a) 2D WP, b) 3D WP. Ilustrujte Polyovu větu.
4. Napište program pro výpočet ceny evropské call a put opce (jako funkci parametrů K , S , σ , r , T).
5. Napište program pro výpočet parametrů citlivosti delta a gamma. Vypočtěte jejich hodnoty pokud $K=50$, $\sigma=0,3$, $r=0$, $T=0,5$, $S_0 = 55$.
6. Nakreslete závislost delty na S pro různé časy expirace T ($T_1=1$, $T_2=0,5$, $T_3=0,1$, $T_4=0,01$).