
ZHENYU CUI, University of Waterloo

Correction de continuité améliorée pour des options discrètes de barrière et rétrospective

Les options de barrière et rétrospective sont les options de trajectoire dépendante les plus populaires échangées sur le marché dérivé. En se basant sur un développement d'ordre supérieur du mouvement brownien approchant la marche aléatoire donnée par Janssen et Van Leeuwaarden (2009), nous prolongeons la « correction de continuité » de Brodie et al (1999) pour développer une méthode plus précise pour fixer le prix des options discrètes de barrière. Nous prolongeons également la technique de Horfelt (2003) pour fixer les prix d'options discrètes rétroactives et proposons une approximation semi-analytique très précise du terme de covariance pour améliorer la correction de continuité des options discrètes rétroactives. Une étude numérique confirme les avantages de notre méthode.