数学与系统科学研究院

计算数学所学术报告

报告人：**Prof. Jun-Feng Yin**

（ ***Tongji University*** ）

报告题目：

Numerical solution for American option pricing

邀请人： 任志茹 博士

报告时间：**2013** 年 **7** 月 **11** 日（周四）

下午 **16:00-17:00**

报告地点： 科技综合楼三层 **311**

计算数学所报告厅

Abstract：

Numerical solution method based on high-order compact (HOC) finite difference scheme is proposed and analyzed for pricing American options. Then, modulus-based successive over-relaxation method is considered for solving the linear complementarity problem. A number of numerical experiments are further presented to show the efficiency of proposed method.

欢迎大家参加！