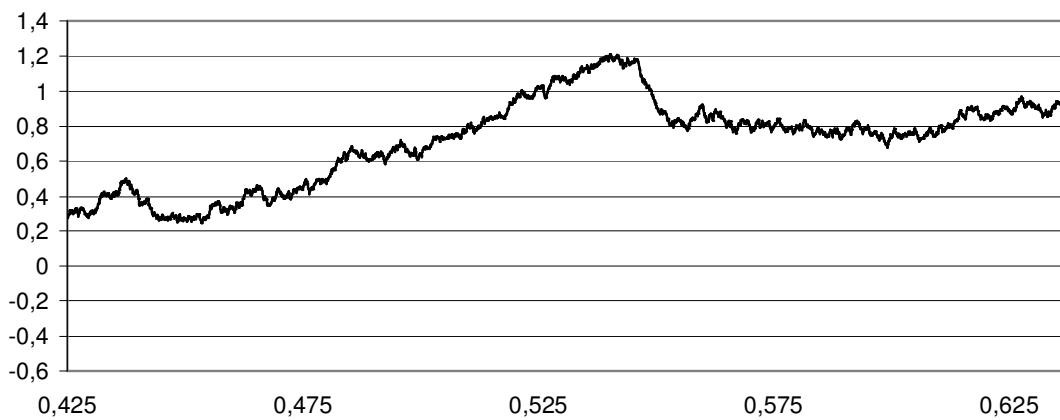
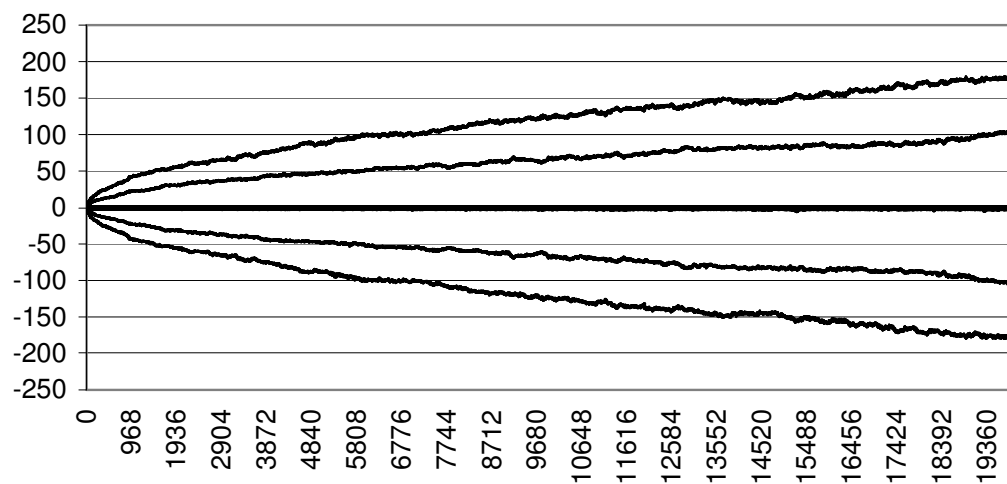


Rysunek 1.1. Przykładowa trajektoria procesu Wienera
Źródło: Opracowanie własne.



Rysunek 1.2. Przykładowa trajektoria procesu Wienera – powiększenie wyszczególnionego na rysunku 1.1. obszaru
Źródło: Opracowanie własne.



Rysunek 1.3. Linie kwantylowe rzędu 0,1, 0,25, 0,5, 0,75 i 0,9 procesu Wienera

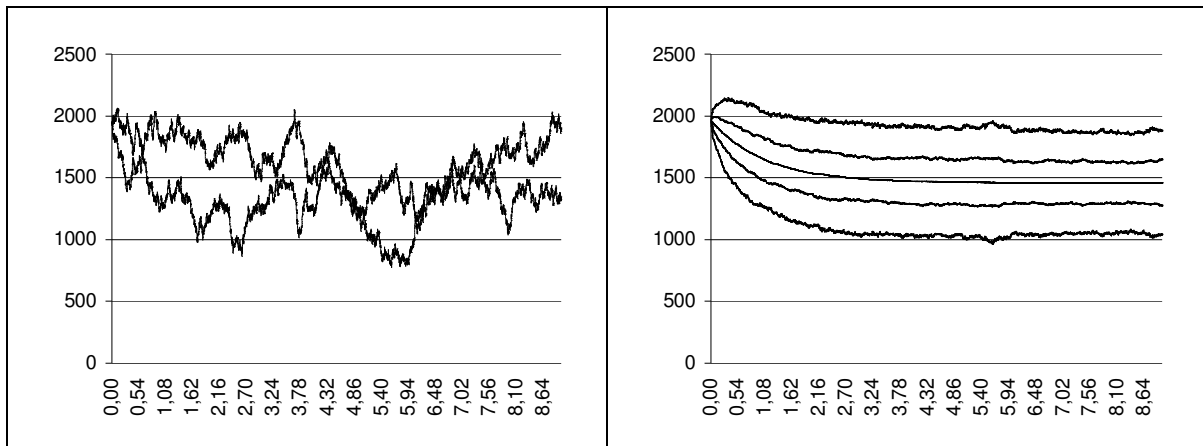
Źródło: Opracowanie własne.

Model Vasička (V) (por. Vasiček [1977])

Model zadany jest poprzez liniowe autonomiczne SRR postaci:

$$\begin{cases} dX_t = (\alpha - \beta X_t)dt + \sigma dW_t, \\ X_{t_0} = x_0 \end{cases}, \quad (1.19)$$

Tabela 1.1. Wybrane trajektorie (pierwsza kolumna) oraz linie kwantylowe (druga kolumna) dla rozwiązania modelu V



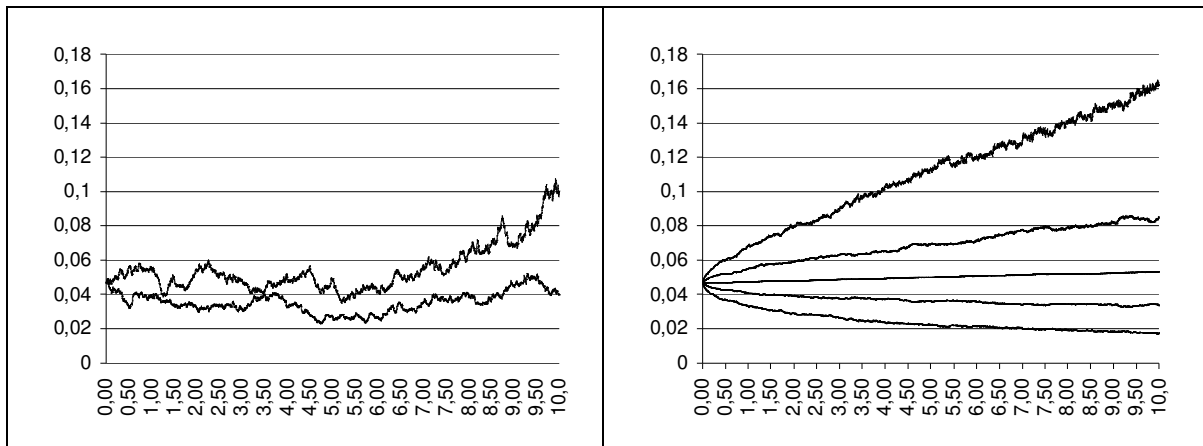
Źródło: Opracowanie własne

Model Blacka i Scholesa (BS) (por. Black i Scholes [1973])

Model zadany jest poprzez liniowe autonomiczne SRR postaci:

$$\begin{cases} dX_t = \beta X_t dt + \sigma X_t dW_t \\ X_{t_0} = x_0 \end{cases}, \quad (1.22)$$

Tabela 1.2. Wybrane trajektorie (pierwsza kolumna) oraz linie kwantylowe (druga kolumna) dla rozwiązania modelu BS



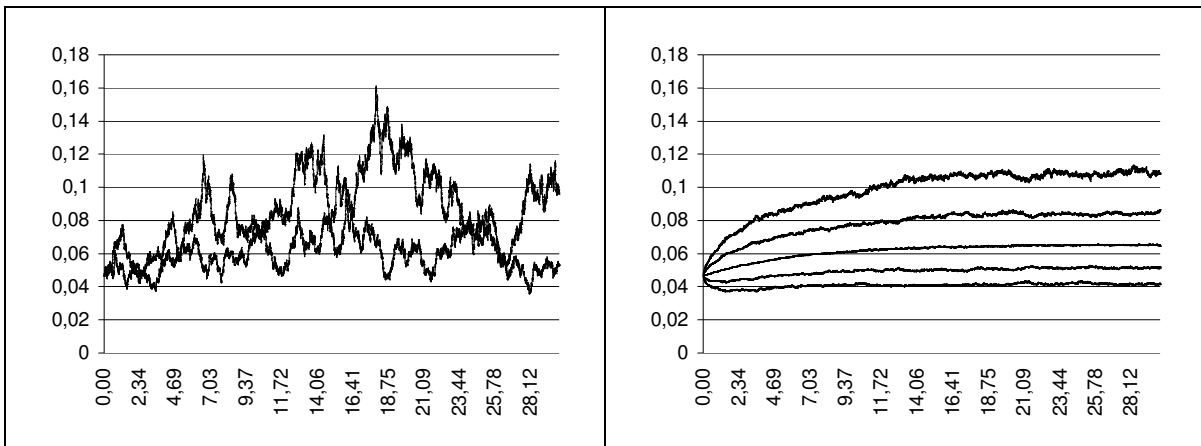
Źródło: Opracowanie własne.

Model Brennana i Schwartza (BSBS) (por. Brennan i Schwartz [1979,1980])

Model zadany jest poprzez liniowe i autonomiczne SRR postaci:

$$\begin{cases} dX_t = (\alpha - \beta X_t)dt + \sigma X_t dW_t, \\ X_{t_0} = x_0, \end{cases} \quad (1.33)$$

Tabela 1.5. Wybrane trajektorie (pierwsza kolumna) oraz linie kwantylowe (druga kolumna) dla aproksymacji rozwiązania modelu BSBS



Źródło: Opracowanie własne.