



СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. *Kuznetsov A., Kyprianou A. E., Pardo J. C., van Schaik K.* A Wiener-Hopf Monte Carlo simulation technique for Lévy processes. — *Ann. Appl. Probab.*, 2011, v. 21, № 6, p. 2171–2190.
2. *Kudryavtsev O., Levendorskiĭ S.* Fast and accurate pricing of barrier options under Levy processes. — *J. Finance and Stochastics*, 2009, v. 13, № 4, p. 531–562.
3. *Кудрявцев О. Е.* Вычисление цен барьерных и американских опционов в моделях Леви. — *Обозрение прикл. и промышл. матем.*, 2010, т. 17, в. 2, с. 210–220.