

[Source](#) | [Model](#) | [Option](#)  
| [Model\\_Option](#) | [Help on mc methods](#) | [Archived Tests](#)

## mc\_lionsregnier2d

Input parameters:

- Number of iterations  $N$
- Generator\_Type
- Number of Exercise Date *exercise\_date\_number*

Output parameters:

- Price  $P$
- Delta1 *delta1*
- Delta2 *delta2*

**Description:** Computation of Bermudan Option Price with the Lions-Regnier algorithm. [1]. [Lions-Regnier Method](#)

## References

- [1] REGNIER H. LIONS P.L. Calcul du prix et des sensibilites d'une option americaine par une methode de monte-carlo. Technical report, Preprint, 2000. [1](#)