

Domaća zadaća iz Financijskog modeliranja 1

Zadatak 9. Promatramo američku put opciju u CRR modelu s parametrima $T > 0$, $-1 < a < 0 < b$ i $S_0 > 0$ te cijenom izvršenja K . Za koje početne vrijednosti cijene dionice S_0 se isplati iskoristiti američku opciju odmah?

Zadatak 10. Dana je američka put opcija s cijenom izvršenja $K = 90$ u CRR modelu s $T = 4$, $a = -0.25$, $b = 0.25$, $r = 0.1$ i $S_0 = 100$. U slučaju da cijena dionice padne četiri puta za redom, izračunajte profit pisca ove opcije.

9. Pročitati analizu toka funkcije $p(0, x)$ sa zadnjeg predavanja. 10. Vrijednost opcije u trenutku $t = 4$ je 58.3594, a vrijednost replicirajućeg portfelja je 80.1152, pa je profit pisca $21.7559 = 80.1152 - 58.3594$.