

1. 使用資料：上課老師講解時使用的 2007/04 資料

TEIAX option

履約價	買權買價	買權賣價	賣權買價	賣權賣價
6900	820	835	8.6	9.1
7000	690	740	12	12.5
7100	630	645	17	18
7200	540	550	26	27
7300	445	470	38	39.5
7400	372	397	55	56
7500	304	307	78	79
7600	231	235	109	110
7700	173	174	148	149
7800	120	121	195	196
7900	80	81	250	258
8000	48.5	49	323	332
8200	15.5	16.5	493	505
8600	1	2	825	855

TEIAX stock

7757	7758
------	------

TEIAX future

7756	7760
------	------

其它：

$r = 1.844\%$

$t = 1\text{month} = 1/12 \text{ year}$

2. 執行 theorem 2,3,4,6,8,9，檢查是否有套利機會，並印出可套利的報價與套利方式