

4.1. Stratégia BOUGHT STRADDLE:

Majme danú stratégiu, ktorá spočíva v kúpe jednej európskej call opcie a jednej európskej put opcie, ktoré sú vypísané na rovnakú akciu, majú rovnaký čas expirácie T a rovnakú expiračnú sumu E . Nakreslite jej payoff diagram, nájdite optimálnu hodnotu tejto stratégie a urobte pre ňu analýzu citlivosti.

4.2. Stratégia BOUGHT STRANGLE:

Majme danú stratégiu, ktorá spočíva v kúpe jednej európskej call opcie s expiračnou sumou E_2 a jednej európskej put opcie s expiračnou sumou E_1 , $E_1 < E_2$, ktoré sú vypísané na rovnakú akciu a majú rovnaký čas expirácie T . Nakreslite jej payoff diagram, nájdite optimálnu hodnotu tejto stratégie a urobte pre ňu analýzu citlivosti.

4.3. Stratégia BULLISH SPREAD:

Majme danú stratégiu, ktorá spočíva v kúpe jednej európskej call opcie s expiračnou sumou E_2 a predaji jednej európskej call opcie s expiračnou sumou E_1 , $E_1 < E_2$, ktoré sú vypísané na rovnakú akciu a majú rovnaký čas expirácie T . Nakreslite jej payoff diagram, nájdite optimálnu hodnotu tejto stratégie a urobte pre ňu analýzu citlivosti.

4.4. Stratégia BEARISH SPREAD:

Majme danú stratégiu, ktorá spočíva v predaji jednej európskej call opcie s expiračnou sumou E_2 a kúpe jednej európskej call opcie s expiračnou sumou E_1 , $E_1 < E_2$, ktoré sú vypísané na rovnakú akciu a majú rovnaký čas expirácie T . Nakreslite jej payoff diagram, nájdite optimálnu hodnotu tejto stratégie a urobte pre ňu analýzu citlivosti.

BONUS:

Vymyslite vlastnú opčnú stratégiu alebo popíšte nejakú, ktorú sme nespomínali. Nakreslite jej payoff diagram, nájdite optimálnu hodnotu tejto stratégie a urobte pre ňu analýzu citlivosti.