

上交所期权定价研究

(请先阅读论文格式规范)

C 题

随着社会的飞速发展和经济全球化的进程,期权因套期保值与风险规避功能而受到越来越多投资者的青睐。期权是一份具有选择权的合约,期权买方拥有在约定期限内以约定价格买入或卖出标的资产的权利;而期权卖方则通过卖出这样一份权利获取权利金,但期权卖方也同时承担了兑付合约的义务。

由于起步比较晚,我国的金融市场目前为止仍是处于初级发展阶段,大部分投资者对于上证 50ETF 期权的认知处于定性的阶段,对于我国高速增长的经济和正国际化的人民币来说,找到一个合理的计算方法来为上证 50ETF 做定量的分析刻不容缓。

以下是上交所提供的关于期权的数据,现需要根据该数据找到一个合理,科学的期权定价模型,并论证该定价模型的合理性。