

- ▶ 承繼上上週的資料，試以履約價16500的買權在下列設定下，回答下列問題：
 - ▶ $S = 16273.38$
 - ▶ $K = 16500$
 - ▶ $T = 14/365$
 - ▶ $r = 0.0166$
 - ▶ implied volatility = 0.14134
- ▶ 以black-scholes model定價，與真實成交價(93.00)的誤差多少？
- ▶ 設計一個實驗來說明CRR binominal pricing model在不同層數設定下($n=10,100,1000$)與理論值black-scholes model定價的誤差。
- ▶ 利用black-scholes model及差分法計算 delta (call price對s的偏微分)，並以此delta說明當交易員賣出一口買權時，要買多少現股才能進行delta hedging避險
 - ▶ 設定一個很小的 ds ，在其他參數不變只更改s的情況下，計算 $(\text{call}(S+ds)-\text{call}(S))/ds$