

Katarzyna Kosińska, Michał Marmol, Klaudia Tuńska

Projekt

25.05.2023

Spis treści

1. Wstęp	2
2. Wycena opcji	3
3. Analiza wrażliwości	4
3.1. Cena wykonania, K	4
3.2. Zapadalność, T	4
3.3. Cena spot, S_0	4
3.4. Liczba kroków, Δt	4
4. Portfel replikujący	5

1. Wstep

— $\Delta t = 1/12, u = e^{\sigma\sqrt{\Delta t}}, d = e^{-\sigma\sqrt{\Delta t}}$

—

—

2. Wycena opcji

3. Analiza wrażliwości

3.1. Cena wykonania, K

3.2. Zapadalność, T

3.3. Cena spot

3.4. Liczba kroków, Δt .

4. Portfel replikujący