

Modelowanie rynków finansowych

Zestaw 5

1. Napisać program Monte-Carlo do wyceny opcji europejskich na rynku idealnym. Wycenić za pomocą tego programu opcję kupna i opcję sprzedaży na akcję, której aktualna cena wynosi $X = 98$ zł, a roczna zmienność $\sigma = 20\%$. Przyjąć, że opcja zostanie wykonana po upływie trzech miesięcy, $T = 0.25$, po cenie $K = 100$ zł, i że stopa wolna od ryzyka wynosi $r = 5\%$. Wyniki porównać z wartościami obliczonymi na podstawie wzoru Blacka-Scholesa.