

Finančné deriváty, letný semester 2014/2015

Bonusová úloha 1

- Môžete kupovať a predávať opcie na akcie GOOG uvedené na nasledujúcej strane (nie samotné akcie). Všetky opcie sú call opcie a ich expirácia je 27. marca 2015. Kupovať a predávať môžete ľubovoľný celočíselný počet opcií.
- Zostavte stratégiu, ktorá zohľadňuje vaše očakávanie o vývoji ceny akcie. Jedinou požiadavkou na stratégiu je, že vaša strata nemôže byť väčšia ako 100 USD, bez ohľadu na cenu akcie v čase expirácie opcií.
- Úlohu môžete vypracovať samostatne alebo v dvojiciach. Stratégie budú po termíne odovzdania zverejnené.
- Odovzdáva sa: slovný popis stratégie (koľko akých opcií kupujete), skript pre Scilab, ktorý kreslí profit diagram vašej stratégie, výsledný profit diagram ako obrázok.
- Odovzdávanie: mailom na adresu beata.ulohy@gmail.com do 26. 2. 2015 (štvrtok) so subjectom **FD 2015 - bonus 1 – nick** (nick vašej skupiny, pod ktorým bude stratégia zverejnená v zozname).
- Hodnotenie:
 - 1 bod za stratégiu spĺňajúcu uvedenú podmienku;
 - +1 bod, ak bude vaša stratégia v čase expirácie zisková;
 - +ďalšie 2 body pre stratégiu, ktorá dosiahne najvyšší zisk.

Ak úlohu riešite v skupine, tieto body dostáva každý člen skupiny.

Google Inc. (GOOG) ★ Watchlist

543.29 **+0.45(+0.08%)** NASDAQ - As of 11:40am EST

March 27, 2015 ▾

In The Money

Calls

Strike [^]	Contract Name	Last	Bid	Ask	Change	%Change	Volume	Open Interest	Implied Volatility
<input type="text" value="Filter"/>									
520.00	GOOG150327C00520000	30.00	27.20	28.40	0.00	0.00%	1	17	20.16%
522.50	GOOG150327C00522500	25.08	25.10	26.50	-5.11	-16.93%	1	10	20.01%
527.50	GOOG150327C00527500	22.70	21.60	22.90	0.00	0.00%	12	26	19.77%
530.00	GOOG150327C00530000	21.50	19.90	21.20	0.00	0.00%	3	40	19.66%
532.50	GOOG150327C00532500	18.70	18.20	19.00	0.00	0.00%	3	6	18.69%
535.00	GOOG150327C00535000	18.10	16.70	17.50	0.00	0.00%	6	12	18.71%
540.00	GOOG150327C00540000	13.40	13.80	14.50	-1.70	-11.26%	1	8	18.40%
542.50	GOOG150327C00542500	13.75	12.50	13.10	0.00	0.00%	1	1	18.23%
545.00	GOOG150327C00545000	9.76	11.20	11.80	0.00	0.00%	1	2	18.09%
547.50	GOOG150327C00547500	9.14	10.10	10.70	0.00	0.00%	1	1	18.13%
550.00	GOOG150327C00550000	8.10	9.00	9.50	-1.40	-14.74%	1	14	17.91%
555.00	GOOG150327C00555000	9.40	7.10	7.60	0.00	0.00%	3	5	17.87%
557.50	GOOG150327C00557500	6.20	6.10	6.90	0.00	0.00%	4	4	18.06%
560.00	GOOG150327C00560000	7.28	5.30	6.10	0.00	0.00%	1	7	17.99%
562.50	GOOG150327C00562500	7.70	4.80	5.40	0.00	0.00%	11	14	17.98%
565.00	GOOG150327C00565000	4.10	4.10	4.70	0.00	0.00%	2	5	17.86%
567.50	GOOG150327C00567500	5.40	3.60	4.10	0.00	0.00%	1	1	17.80%
570.00	GOOG150327C00570000	4.29	3.10	3.70	0.00	0.00%	1	16	18.02%
580.00	GOOG150327C00580000	2.31	1.45	1.95	0.00	0.00%	7	12	17.56%