

Povzetek

V uvodu diplome je teoretično opisano kaj je gotovina, kaj so opcije in kaj so vrednostni papirji. Definirala sem tudi njihove pomene in funkcije.

V drugem poglavju so opisane osnove vrednotenja opcij. To poglavje zajema opis sedanje vrednosti, opis principa arbitraže in opis vrednotenja opcij v preprostih modelih, ter formulacijo z verjetnostjo in opcije odvisne od poti.

Zadnje, tretje, poglavje pa so konkretni primeri binomskih modelov. Opisani sta dve opciji: evropska opcija in digitalna opcija. V tem poglavju je nekaj primerov izračunane vrednosti opcij.

Math.Subj.Class.(2000): 62 P05, 60J27

Ključne besede:

option - opcija

porfolio - listnica oz.premoženje

European option - evropska opcija

stock - delnica

put option - prodajna opcija

call option - nakupna opcija

random variable - slučajna spremenljivka

Literatura

- [1] Musiela, Rutkowski: Martingales Methods in Financial Modeling,(Spring).
- [2] Capinski, Zastawniak: Mathematics for finance, (Spring).
- [3] Mramor: Uvod v poslovne finance, (Spring).
- [4] Gemmill: Options pricing - An international perspective, (Spring).
- [5] Baxter, Rennie: Financial Calculus - Cambridge University Press, (Spring).
- [6] Shreve, Steven E.: Stochastic Calculus for Finance; The Binomial Asset Pricing Model - Cambridge University Press, (Spring).