

Вопросы по теории опционов

1. Формулы Блэка-Шоулса для европейских колл и пут опционов.
2. Определение моментов остановки и марковских моментов. Теорема о преобразовании свободного выбора для мартингалов. Неравенство для марковских моментов.
3. Свойства функции стоимости $F(S, t)$ американского опциона.
4. Множество немедленного исполнения американского колл-опциона. Его свойства.
- 5а. Дифференциальное уравнение для стоимости американского опциона (вывод из уравнения Беллмана).
- 5б. Дифференциальное уравнение для стоимости американского опциона (вывод с помощью Δ -портфеля).
6. Вариационное неравенство для стоимости американского опциона.
7. Оптимальное решающее правило для американского колл-опциона в случае отсутствия дивидендов.
8. Оптимальное решающее правило и стоимость бесконечного американского колл-опциона.
9. Оптимальное решающее правило и стоимость бесконечного американского пут-опциона.
10. Интегральное уравнение для стоимости американского опциона.
11. Нижняя оценка стоимости американского опциона.
12. Верхняя оценка стоимости американского опциона.
13. Оценка бесконечного русского опциона с нулевой ценой исполнения.
14. Оценка бесконечного пут-опциона lookback.
15. Оценка бесконечного колл-опциона lookback.
16. Оценка бесконечного стрэнгл-опциона.
17. Оценка бесконечного опциона Марграбе.
18. Оценка бесконечного двустороннего опциона Марграбе.
19. Оценка бесконечного альтернативного опциона.