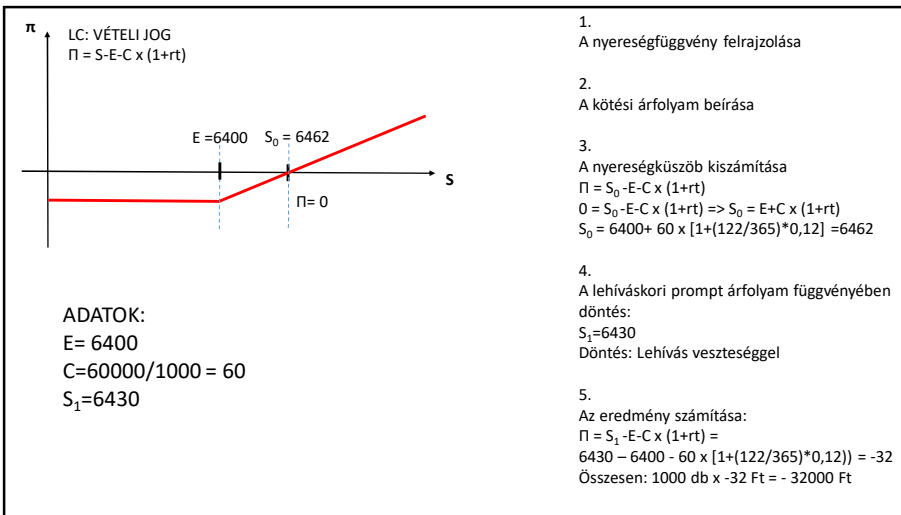


Opció 2. feladat

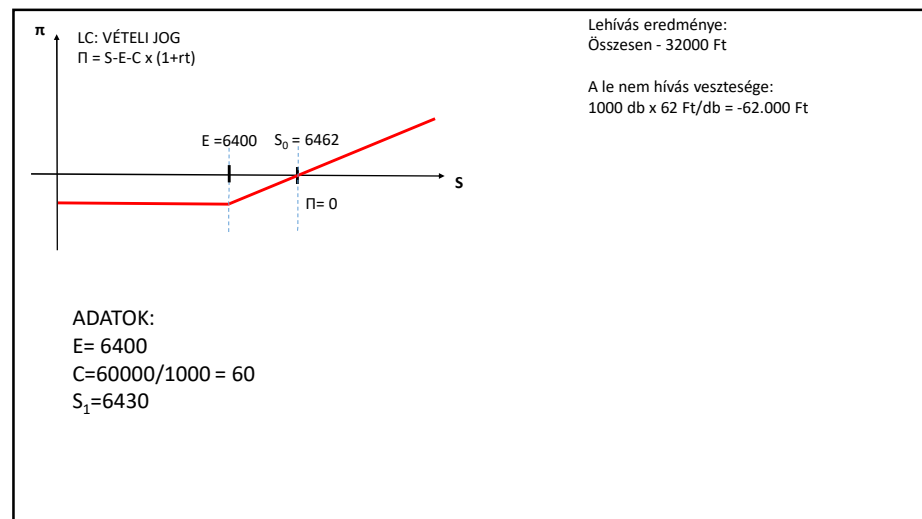
Tételezzük fel, hogy négy hónap (122 nap) múlva 1.000 db vállalati részvényt szeretne vásárolni. Az értékpapír mai spot árfolyama 6.200 Ft. Úgy véli, hogy időközben a részvény árfolyama emelkedni fog. Az árfolyamkockázat kivédése érdekében 60.000 Ft-ért európai vételi opciót vásárol. A kötési árfolyam 6.400. A piaci kamatláb 12%. Hogyan dönt, ha az opció lejáratakor a spot árfolyam 6.430 Ft?

- az opció lehívásának pénzügyi eredménye
- az opció lehívásának pénzügyi vesztesége
- döntés

1



2



3