

Název práce: Oceňování opcí

Autor: Martin Švec

Katedra (ústav): Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí bakalářské práce: Doc. RNDr. Jan Hurt, CSc.

e-mail vedoucího: hurt@karlin.mff.cuni.cz

Abstrakt: V předložené práci studujeme opce a metody jejich oceňování. Uvedeme si základní informace o opcích, rozdělíme si je podle typu a zmíníme se o možnostech využití opcí. Hlavní náplní této práce bude nalezení správné hodnoty opce. Nejdříve si uvedeme hraniční hodnoty, kterých opce může nabývat, a poté se zaměříme na dva nejdůležitější modely oceňování opcí, Black-Scholesuv a binomičtý model. Práce zahrnuje zjednodušené odvození obou modelů. V příloze na CD jsou v systému Wolfram Mathematica[®] 6.0 naprogramovány oba modely oceňování opcí a v tomto softwaru byly také vytvořeny obrázky, kterými je tento text doplněn.

Klíčová slova: Opce, Oceňování opcí, Black-Scholesuv model, Binomičtý model

Title: Options pricing

Author: Martin Švec

Department: Department of Probability and Mathematical Statistics

Supervisor: Doc. RNDr. Jan Hurt, CSc.

Supervisor's e-mail address: hurt@karlin.mff.cuni.cz

Abstract: In the present thesis we study options and methods of options pricing. We introduce basic information about options, type of options and applications. Main contents of this work will be finding the price of option. At first we introduce natural boundaries, then we focus on two most important models, Black-Scholes model and binomial model. This work includes short development both of models. In appendix on CD are programmed both of options pricing models in Wolfram Mathematica[®] 6.0. The pictures were created using the same system.

Keywords: Option, Option Pricing, Black-Scholes model, Binomial model