

Cours PRB222

Valeurs Numériques

Options asiatiques

Attention à avoir r_A dans la distribution à terme et r en actualisation (terme en $e^{(r_A-r)T}$ en facteur devant S_0).

M_1	M_2	r_A	σ_A	d_1	d_2	P_{Call}	P_{Put}
1,002504	1,020280	0,005002	0,173639	0,081760	-0,041021	0,050025	0,047533

Cas discret

$\frac{\Delta t}{252}$	M_1	M_2	r_A	σ_A	d_1	d_2	P_{Call}	P_{Put}
$\frac{1}{252}$	1.00252	1.0205	0.00504177	0.174667	0.0821647	-0.0413433	0.0503236	0.0478120

Pour Q6.

r_E	σ_E	d_1	d_2	P_{Call}
-0,002460	0,174236	0,051619	-0,071585	0,048236

TW surestime un peu dans la zone de paramètres de l'énoncé (mais pas pour K moindre

Options sur panier

σ_B	r_B	d_1	d_2	P_{Call}	P_{Put}
0,307045	0,01	0,263173	-0,171055	0,360514	0,320911

Greques

d_1	d_2	P_{Call}	P_{Put}	Δ_{Call}	Δ_{Put}	Γ	vega
0,259272	-0,164992	0,176415	0,156614	0,602287	-0,397713	0,909236	0,545542

Echantillonnage préférenciel

$K = 1$

d_1	d_2	P_{Call}
0,259272	-0,164992	0,176415

$K = 2.5$

d_1	d_2	P_{Call}
-1,900445	-2,324710	0,004075

Option d'échange

σ_{eq}	d_1	d_2	P_{rix}
0,278388	0,196850	-0,196850	0,156055

Option Bermuda

d_1	d_2	$Prix$	K
0,447214	0	0,125058	0,8023864

Option à Barrière

d_1	d_2	$Prix$	$Prix\ barriere\ in\ fine$
0,247487373	0,035355339	0,069272205	0,054403397

Var Swap

$\mathbb{E} \left[\int_0^T \sigma_s^2 ds \right]$	$Prix\ VarSwap$
0,132844261	0,010318432

Option Best of

d_1	d_2	P_{Put}
0,265361	-0,102062	0,129302