

以下的哪些参数与股票欧式看涨期权的价格总是正相关- 可以介绍下什么叫什么是欧式看涨期权？-股识吧

一、欧式看涨期权

期权是指在未来一定时期可以买卖的权力，是买方向卖方支付一定数量的金额（指权利金）后拥有的在未来一段时间内（指美式期权）或未来某一特定日期（指欧式期权）以事先规定好的价格（指履约价格）向卖方购买或出售一定数量的特定标的物的权力，但不负有必须买进或卖出的义务。

期权交易事实上是这种权利的交易。

买方有执行的权利也有不执行的权利，完全可以灵活选择。

期权分场外期权和场内期权。

场外期权交易一般由交易双方共同达成。

看跌期权给买方以权利而不是义务，在一段特定的时间内按一特定价格卖出一种底层证券。

一旦买方决定履行期权而出售该底层证券，看跌期权的卖方有买进的义务看涨期权：期货期权的买方向期货期权的卖方支付一定数额的权利金后，即拥有在期权合约的有效期内，按事先约定的价格向期权卖方买入一定数量的相关期货合约，但不负有必须买进的义务

二、以下的哪些参数与股票欧式看涨期权的价格总是正相关

期权交易实战中比你上面说的要简单许多，一个是做股票通过期权进行保险。这个你自然会明白。

一个是通过期权市场投机，特别是贴近现有股票价格的期权（无论是购权还是沽权），随着股票价格的变化，价格变化很剧烈，有时候当天价格变化幅度达到40%，何况期权还有杠杆，可见这一市场的获利潜力和亏损风险有多大。

但是期权市场是t+0市场，可以随时平仓。

你说的情况是套利，这种形式主要是安全。

但期权市场真正上市后，将是个投机为主的市场。

很有前景，但现在真正了解的并不多。

比期货市场好！

三、可以介绍下什么叫什么是欧式看涨期权？

看涨期权则是估计这个股票会涨，可以在未来以一定的价格买进。

看跌期权是估计估计会跌，可以在未来以一定价格卖出。

回答来源于金斧子股票问答网

四、跪求欧式看跌期权的题目解答！！

(1)看涨期权定价公式： $C = SN(d1) - K \exp[-r(T-t)]N(d2)$
 $d1 = [\ln(S/K) + (r + \sigma^2/2) * (T-t)] / (\sigma * \sqrt{T-t})$
 $d2 = d1 - \sigma * \sqrt{T-t}$ 根据题意， $S=30$ ， $K=29$ ， $r=5\%$ ， $\sigma=25\%$ ， $T-t=4/12=0.3333$
 $d1 = [\ln(30/29) + (0.05 + 0.0625/2) * 0.3333] / (0.25 * \sqrt{0.3333}) = 0.4225$
 $d2 = d1 - 0.25 * \sqrt{0.3333} = 0.2782$
 $N(d1) = 0.6637$ ， $N(d2) = 0.6096$
看涨期权的价格 $C = 30 * 0.6637 - 29 * 0.9835 * 0.6096 = 2.5251$
(2)看跌期权的定价公式： $P = K \exp[-r(T-t)][1 - N(d2)] - S * [1 - N(d1)]$
看跌期权的价格 $P = 29 * 0.9835 * 0.3904 - 30 * 0.3363 = 1.0467$
(3)看涨看跌期权平价关系 $C - P = S - K \exp[-r(T-t)]$
左边 $= 2.5251 - 1.0467 = 1.4784$ ，右边 $= 30 - 29 * 0.9835 = 1.4784$
验证表明，平价关系成立。

五、期货投资分析首考股票欧式期权的价格计算问题

用bionomial tree 去算，你没有variance，不可以用b-s模型，the price of three months $= (44, 36)$ strike price $= 42$ ，so $C(up) = 2$ ， $c(d) = 0$ ，discount rate of 3 months $= 1/1.02$
ratio $= (2-0)/(44-36) = 0.25$ ， $0.25 * 40 - (\text{call option price}) = (1/1.02) * 0.25 * 36$ ，the price of call $= 10 - 8.82 = 1.18$

六、为什么看涨期权在其执行价格高于标的股票的价格时仍以正的价格销售

期权的价值有两部分组成：内涵价值和时间价值。

看涨期权内涵价值就是 $\text{Max}(0, \text{股票价格} - \text{行权价})$ ，价外的看涨期权内涵价值为0，但其时间价值大于0，所以总价值大于0。

简单来说，买入看涨期权等于买入一个权利，这个权利你可以行使也可以不行使。

到期的时候，如果行权价高于股票价格的时候，期权的价值为（股票价格 -

行权价)；

如果行权价低于股票价格时候，期权价值为0，因为没有人会笨到用更高的行权价去购买股票。

无论如何，你的收益总是大于等于0的，所以期权价格必须为正。

七、金融学4、假设投资者购买某公司100股股票的欧式看涨期权

- 1.不行使期权的话，只损失期权费，也就是250元。
- 2.如果是看涨期权，就不损失了。反而赚了250元。

八、以下哪个组合可以合成一份欧式看跌期权

3. 符号解释：T-t：还有多少天合约到期；

$e^{-r(T-t)}$ 的次方是连续复利的折现系数；

$Ke^{-r(T-t)}$ ：K乘以 $e^{-r(T-t)}$ 次方，也就是K的现值。

组合A：一份欧式看涨期权C，行权价K，距离到期时间T-t。

现金账户 $Ke^{-r(T-t)}$ ，利率r，期权到期时恰好变成行权价K。

组合B：一份有效期和行权价格与看涨期权相同的欧式看跌期权P，加上一单位标的物股票S。

根据无套利原则推导：看到期时这两个投资组合的情况。

(a).期权到期时，若股价 S_T 大于K，投资组合A，将行使看涨期权C，花掉现金账户K，买入标的物股票，股价为 S_T 。

投资组合B，放弃行使看跌期权，持有股票，股价为 S_T 。

(b).期权到期时，若股价 S_T 小于K：投资组合A，放弃行使看涨期权，持有现金K。

投资组合B，将行使看跌期权，卖出标的物股票，得到现金K(c).股价 S_T 等于K：两个期权都不行权，投资组合A现金K，投资组合B股票价格等于K。

从上面的讨论我们可以看到，无论股价如何变化，到期时两个投资组合的价值一定相等，根据无套利原则，两个价值相等的投资组合价格一定相等。

所以我们可以得到 $C + Ke^{-r(T-t)} = P + S$ 。

即：认购期权价格C与认沽期权的价格P的差等于标的物股票现价与行权价K现值的差。

1、B-S模型是看涨期权的定价公式，根据售出一购进平价理论(Put-callparity)可以推导出有效期权的定价模型，由售出一购进平价理论，购买某股票和该股票看跌期权的组合与购买该股票同等条件下的看涨期权和以期权交割价为面值的无风险折扣发行债券具有同等价值，以公式表示为： $S+PE(S, T, L)=CE(S, T, L)+L(1+r)^{-T}$ ，移项得： $PE(S, T, L)=CE(S, T, L)+L(1+r)^{-T}-S$ ，将B-S模型代入整理得： $P=L \cdot E^{-rT} \cdot [1-N(D2)]-S[1-N(D1)]$ 此即为看跌期权初始价格定价模型。

2、看跌期权又称卖权选择权、卖方期权、卖权、延卖期权或敲出。

看跌期权是指期权的购买者拥有在期权合约有效期内按执行价格卖出一定数量标的物的权利，但不负担必须卖出的义务。

3、如果未来基础资产的市场价格下跌至低于期权约定的价格（执行价格），看跌期权的买方就可以以执行价格（高于当时市场价格的价格）卖出基础资产而获利，所以叫做看跌期权。

如果未来基础资产的市场价格上涨超过该期权约定的价格，期权的买方就可以放弃权利。

参考文档

[下载：以下的哪些参数与股票欧式看涨期权的价格总是正相关.pdf](#)

[《股票早上买入要隔多久才可以卖出》](#)

[《股票正式发布业绩跟预告差多久》](#)

[《股票多久可以买卖次数》](#)

[《股票要多久提现》](#)

[《买了8万的股票持有多久可打新》](#)

[下载：以下的哪些参数与股票欧式看涨期权的价格总是正相关.doc](#)

[更多关于《以下的哪些参数与股票欧式看涨期权的价格总是正相关》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/book/47408515.html>