

## Ders # 11 için Quiz

2 ve 5 aylık dönemlerde temettü ödemeleri olan bir hisse senedi için Avrupa stili alım opsiyonu anlaşması yapıldığını varsayalım. Her temettü tarihinde temettünün \$0.50 olması bekleniyor. Cari hisse fiyatı \$50 ve kullanım fiyatı \$50. Hisse senedi oynaklığı yıllık yüzde %20 ve risksiz oran yıllık %8.329. Oynaklık, sürekli bileşik olarak hesaplanıyor, faiz basit faizle hesaplanıyor, vade 6 ay. Black-Scholes/Merton modelini kullanarak bu alım opsiyonunun fiyatını ve deltasını hesaplayın.

(Hatırlatma: Bütün gerekli işlemleri gösterirseniz, hata yaptığımız takdirde kısmi puan alma şansınızı artırırız)<sup>1</sup>.

---

<sup>1</sup>Bu soru daha önceki arasnav sorularından biridir. Bu sorunun sınavdaki ağırlığı %25'tir