

Finančné deriváty
Letný semester 2013/2014

Bonusová úloha 1 (zverejnené 19. 2. 2014):

- Môžete kupovať a predávať opcie na akcie YHOO uvedené na nasledujúcej strane (nie samotné akcie). Kupovať a predávať môžete ľubovoľný celočíselný počet opcií (teda nie ste obmedzovaní reálnym obchodovaním v stovkách kusov, ale nemôžete ani obchodovať s neceločíselnými počtami).
- Zostavte stratégiu, ktorá zohľadňuje vaše očakávanie o vývoji ceny akcie. Jedinou požiadavkou na stratégiu je, že vaša strata nemôže byť väčšia ako 100 USD, bez ohľadu na cenu akcie v čase expirácie opcií.
- Úlohu môžete vypracovať samostatne alebo v skupinách, v skupine môžu byť maximálne 4 ľudia. Stratégie budú po termíne odovzdania zverejnené.
- Odovzdáva sa: slovný popis stratégie (koľko akých opcií kupujete), skript pre Scilab, ktorý kreslí profit diagram vašej stratégie, výsledný profit diagram ako obrázok.
- Odovzdávanie: mailom na adresu bs.ulohy@gmail.com do 26. 3. 2014 (streda) so subjectom FD 2014 - bonus 1 – nick, v ktorom uvediete aj nick vašej skupiny, pod ktorým bude stratégia zverejnená v zozname.
- Hodnotenie:
 - 1 bod za stratégiu spĺňajúcu uvedenú podmienku;
 - +1 bod, ak bude vaša stratégia v čase expirácie zisková;
 - +ďalšie 2 body pre stratégiu, ktorá dosiahne najvyšší zisk.

Ak úlohu riešite v skupine, tieto body dostáva každý člen skupiny.

Yahoo! Inc. (YHOO) - NasdaqGS ★ Follow

38.23 **↑0.29 (0.75%)** Feb 14, 4:00PM EST | After Hours : **38.34** **↑0.11 (0.29%)** Feb 14, 7:47PM EST

Options

View By Expiration: [Feb 14](#) | **[Mar 14](#)** | [Apr 14](#) | [Jul 14](#) | [Jan 15](#) | [Jan 16](#)

Options Expiring Saturday, March 22, 2014

Calls							Strike Price
Symbol	Last	Change	Bid	Ask	Volume	Open Int	
YHOO140322C00020000	20.22	0.00	16.60	19.55	1	57	20.00
YHOO140322C00021000	19.80	0.00	15.65	18.55	20	30	21.00
YHOO140322C00023000	16.90	0.00	13.65	16.90	6	21	23.00
YHOO140322C00024000	14.19	↑0.58	14.05	14.35	2	0	24.00
YHOO140322C00025000	13.50	0.00	13.15	13.30	10	47	25.00
YHOO140322C00026000	12.30	↑3.30	12.10	12.35	2	52	26.00
YHOO140322C00027000	9.10	0.00	11.10	12.30	6	30	27.00
YHOO140322C00028000	10.50	0.00	10.20	10.30	10	248	28.00
YHOO140322C00029000	12.60	0.00	9.10	10.50	12	18	29.00
YHOO140322C00030000	8.39	↓0.11	8.20	8.35	5	1,186	30.00
YHOO140322C00031000	7.36	↓0.18	7.25	7.35	91	683	31.00
YHOO140322C00032000	6.75	0.00	6.25	6.40	108	3,020	32.00
YHOO140322C00033000	5.50	↓0.32	5.35	5.45	30	2,585	33.00
YHOO140322C00034000	4.55	↓0.12	4.45	4.55	30	2,030	34.00
YHOO140322C00035000	3.65	↓0.29	3.65	3.70	950	16,113	35.00
YHOO140322C00036000	2.86	↓0.30	2.86	2.91	437	3,462	36.00
YHOO140322C00037000	2.16	↓0.29	2.18	2.22	173	16,035	37.00
YHOO140322C00038000	1.63	↓0.21	1.62	1.65	535	4,261	38.00
YHOO140322C00039000	1.16	↓0.19	1.15	1.18	3,147	10,596	39.00
YHOO140322C00040000	0.81	↓0.19	0.80	0.83	456	35,589	40.00
YHOO140322C00041000	0.55	↓0.13	0.54	0.57	399	3,919	41.00
YHOO140322C00042000	0.36	↓0.11	0.36	0.38	337	7,214	42.00
YHOO140322C00043000	0.24	↓0.07	0.23	0.25	605	4,084	43.00
YHOO140322C00044000	0.19	↓0.03	0.15	0.17	112	6,059	44.00
YHOO140322C00045000	0.11	↓0.04	0.11	0.12	17	2,757	45.00
YHOO140322C00046000	0.09	↓0.02	0.06	0.09	7	662	46.00
YHOO140322C00047000	0.06	↓0.04	0.04	0.06	10	464	47.00
YHOO140322C00048000	0.05	0.00	0.03	0.05	166	571	48.00
YHOO140322C00049000	0.06	0.00	0.02	0.06	34	336	49.00
YHOO140322C00050000	0.04	0.00	0.01	0.03	1	2,257	50.00

Highlighted options are in-the-money.