

CRR

Optionspreise

für $A_0 = 150$, $u = 6/5$, $d = 3/5$, $r = 0$, $K = 150$:

N	Europäischer Call	Amerikanischer Call	Europäischer Put	Amerikanischer Put
1	20.	20.	20.	20.
2	29.3333	29.3333	29.3333	29.3333
3	32.3556	32.3556	32.3556	32.3556
4	33.9911	33.9911	33.9911	33.9911
5	41.4562	41.4562	41.4562	41.4562
6	45.6291	45.6291	45.6291	45.6291
7	47.0013	47.0013	47.0013	47.0013
8	49.3045	49.3045	49.3045	49.3045
9	54.1529	54.1529	54.1529	54.1529
10	56.7987	56.7987	56.7987	56.7987

für $A_0 = 150$, $u = 6/5$, $d = 3/5$, $r = 0.01$, $K = 150$:

N	Europäischer Call	Amerikanischer Call	Europäischer Put	Amerikanischer Put
1	20.297	20.297	18.8119	18.8119
2	30.2111	30.2111	27.2555	27.7211
3	33.8187	33.8187	29.4072	30.6489
4	35.8866	35.8866	30.0336	30.9795
5	43.6777	43.6777	36.3976	37.4248
6	48.2922	48.2922	39.5989	41.3409
7	50.1376	50.1376	40.0453	42.6478
8	52.7726	52.7726	41.2951	43.4713
9	57.8794	57.8794	45.0304	47.2375
10	60.8897	60.8897	46.6827	49.6108