

BS - Modell

Optionspreise

für einen Europäischen Call mit $A_0 = 42$, $K = 40$, $r = 0.1$, $\sigma = 0.2$:

T	Optionspreis
0.2	3.25236
0.5	4.75942
0.8	6.04608
1.0	6.83707
1.5	8.66386
2.0	10.3376

für einen Europäischen Call mit $A_0 = 42$, $K = 40$, $r = 0.05$, $\sigma = 0.2$:

T	Optionspreis
0.2	2.95763
0.5	4.0805
0.8	4.99517
1.0	5.54316
1.5	6.77979
2.0	7.88961