

OPTIONER OCH MATEMATIK (CTH[*TMA155*],GU[*MAM690*])
RÄKNEÖVNING 3

Kap 3: Ö1,3,4,5,6,7

Övning. Låt

$$F = C(t, S(t), K; T) - P(t, S(t), K; T).$$

Visa att

$$S(t) - K \leq F \leq S(t) - Ke^{-r(T-t)}.$$