

## Opgave 14.7

Op een bepaald moment zijn de volgende marktgegevens bekend:

<b>EUR/USD spotkoers</b>	<b>1,3450</b>
<b>Termijnkoersen</b>	
<b>1 maand</b>	<b>1,3453</b>
<b>2 maanden</b>	<b>1,3457</b>
<b>3 maanden</b>	<b>1,3460</b>
<b>Volatiliteit EUR/USD</b>	
<b>1 maand (30 dagen)</b>	<b>4%</b>
<b>2 maanden (60 dagen)</b>	<b>6%</b>
<b>3 maanden (90 dagen)</b>	<b>7%</b>

- Bereken de optiepremies voor een EUR **call** / USD put optie met een looptijd van respectievelijk 1, 2 en 3 maanden en een uitoefenprijs van 1,3700. Gebruik hiervoor het werkblad 'FX forward rate en optiepremie'.
- Wat is de premie voor een EUR **put** /USD call optie met een uitoefenprijs van 1,3700 en een looptijd van drie maanden?
- Wat is de intrinsieke waarde en wat is de verwachtingswaarde van deze EUR put / USD call optie?
- Welk verband geldt er blijkbaar voor de verwachtingswaarde van een driemaands EUR call / USD put optie en de verwachtingswaarde van een driemaands EUR put / USD call optie met dezelfde uitoefenprijs?