Übungsaufgaben zur
“ Mathematik IV für Wirtschaftswissenschaftler ”
Präsenzaufgaben Serie 5

Wir betrachten einen Wertpapiermarkt mit einem Zeithorizont von T=2 sowie einen claim X gemäß folgender Tabelle:

ω	B_0	S_0	B_1	S_1	B_2	S_2	X
1	1	8	1	10	1	12	7
2	1	8	1	10	1	9	4
3	1	8	1	6	1	9	4
4	1	8	1	6	1	5	0

Bestimmen Sie den Preis von X zur Zeit 0 mit Hilfe einer Reduplikationsstrategie.