

PRZYKŁADOWE PYTANIA NA EGZAMINIE CERTYFIKOWANEGO ANALITYKA INWESTYCYJNEGO

[Zadanie 3] - Instrumenty Pochodne (20 pkt.)

W swoim portfelu posiadasz 10 opcji z GPW o tickerze: **OW20U252600**, która jest obecnie kwotowana po 140 pkt.

1. Czy posiadając taką opcję w portfelu wymagany jest od Ciebie depozyt zabezpieczający? Jeżeli tak podaj jej przybliżoną wartość, jeżeli nie odpowiedź krótko uzasadnij. *(5 pkt)*
2. Jeżeli indeks WIG20 wynosi 2630 pkt. to jaka jest łączna wartość wewnętrzna i wartość czasowa wszystkich opcji w Twoim portfelu? *(5 pkt)*
3. Jeżeli w Twoim portfelu jest krótka pozycja w opcjach z polecenia jak możesz zabezpieczyć swój portfel przed stratami. Podaj 2 propozycje zmniejszenia ryzyka dla Twojego portfela. *(5 pkt)*
4. Wyjaśnij na czym polega strategia opcyjna Covered Call i narysuj jej profil wypłaty. *(5 pkt)*