

Implisitt Volatilitet og Oppkjøp

Espen Haug, espen.haug@nmbu.no

I hvilken grad påvirkes implisitte volatiliteter av oppkjøpsforsøk i forkant og etterkant? Hvordan påvirkes ulike risikoparametere av oppkjøp. Jeg tenker her spesielt på det nordiske aksjemarkedet. Som forstudie bør man først prøve å finne ut hva slags studier som er gjort her både i Norge og utlandet. Kan endring i implisitte volatiliteter være et verktøy for å predikere økt sannsynlighet for oppkjøp?