

Rahoituksen tilastotiede

Tenttikysymykset

2010, Helmikuu 08

- 1) Määrittele (a) forward sopimus ja (b) futuuri sopimus.
Explain (a) forward contract and (b) futures contract.
- 2) Johda arbitraasivapaa hinta futuurisopimukselle.
Derive the arbitrage free forward price for a futures contract.
- 3) Määrittele mitä tarkoitetaan jakaumalla, jolla on Pareto vasen häntä ja Pareto oikea häntä.
Define a distribution with Pareto right and left tails.
- 4) (a) Määrittele yhden askeleen binäärimalli osakkeen hintakehitykselle.
Define the single step binary model for stock evolution.
(b) Johda hinta Eurooppalaiselle optiolle binäärimallissa.
Find the price of an European option in this model.