Зайцев Н. В. ПИ20-1В Контрольная работа Вариант 10

Задания 3, 6, 2, 13, 19, 20

**Тема 7. Потоки платежей.**

**VII: Задание 3**

S: Для потока платежей средний срок с точностью до 0,01 равен …

Изображение выглядит как текст, рукописный текст, Шрифт, число

Автоматически созданное описание

**Тема 8. Обыкновенные ренты. Переменные условия и конверсия.**

**VIII: Задание 6**

S: Размер вклада, обеспечивающего получение в конце каждого года 22000 руб. бесконечно долго при сложной ставке 11% годовых с точностью до 0,01 руб. равен …

Изображение выглядит как текст, рукописный текст, Шрифт, рукописный

Автоматически созданное описание

**Тема 9. Срочные и непрерывные ренты.**

**IX: Задание 2**

S: Мужчина 40 лет положил в банк определённую сумму денег, чтобы по достижении им пенсионного возраста 60 лет в течение 15 лет в начале каждого месяца снимать по 10000 рублей. Годовой процент 8% капитализируется в конце года. Указанная ежемесячная сумма с точностью до 0,01 равна …

Изображение выглядит как текст, рукописный текст, Шрифт, чернила

Автоматически созданное описание

**Тема 10: Облигации.**

**X: Задание 13**

S: Облигация со сроком погашения 5 лет и купонной ставкой 8% имеет доходность к погашению 5%. Дюрация облигации, выраженная в годах с точностью до 0,01, равна …

Изображение выглядит как текст, рукописный текст, Шрифт, чернила

Автоматически созданное описание

**Тема 11. Опционы.**

**XI: Задание 19**

S: Текущая цена актива равна 1000 руб. Предполагается, что месяц спустя цена актива может быть равна 1400 руб. или 800 руб. Цена исполнения стоимость месячного колл опциона на этот актив равна 1100 руб. Процентная ставка постоянна, начисляется ежемесячно и равна 9% годовых. В рамках однопериодной модели ценообразования опционов текущая цена опциона, выраженная в рублях, равна…

Изображение выглядит как текст, рукописный текст, Шрифт, чернила

Автоматически созданное описание

**Тема 12. Портфельный анализ.**

**XII: Задание 20**

S: Портфель минимального риска из двух независимых бумаг (0,65; 0,3), (0,48; *x*) (первая цифра доходность ценной бумаги, вторая - ее риск) имеет вид (0,65; 0,35). Риск портфеля минимального риска равен...

Изображение выглядит как текст, рукописный текст, Шрифт, число

Автоматически созданное описание