----------------------------------------------------------作业正文----------------------------------------------------------

1. **PPT课后作业第一题**

答：

由题可得S=20，T-t=0.25，r=0.1



故该股票3个月期远期价格约为20.51元。



故这份交易数量为100单位的远期合约多头方的价值为-551元。

1. **PPT课后作业第二题**

答：

（1）由题可得S=30，r=0.06







故该远期价格约为28.89元；若交割价格等于远期价格，则远期合约的初始价值为0。

（2）由题可得S=35，r=0.06







故此时远期价格约为34.52元，该合约空头价值约为-554.62元。

1. **课后思考题第三题**

答：

由题可得K=910，S=900







故远期的多头价值约为2.17元，空头价值约为-2.17元，远期价格约为1361.13元。

1. **课后思考题第四题**
2. 期限为3个月，时间自现在开始一个月内有效
3. 起息日：4月14日，星期三
4. 确定日：5月12日，星期三
5. 结算日：5月14日，星期五
6. 到期日：8月16日，星期一（8月14、8月15为非营业日）
7. 结算金：
8. **课后思考题第六题**
9. 此时这份合约的价值为0



故交割价格应该约为40.35美元。

1. 



故此时的远期价格约为41.22美元，远期价值约为0.84美元。

----------------------------------------------------------作业正文----------------------------------------------------------

姓名：胡静雯

学号：17241061

得分：