

払うプレミアムが 100 ドルとした場合において、以下の場合で公平なディールにするために払うべき額を計算しましょう。

1) レクチャーで 1200 ドルとしていた額が 1125 ドルとなった場合

(40%の確率で 1125 ドルとなり、60%の確率で 1000 ドルとなる)

解答)

$$0.4 \times 250 + 0.6 \times 0 = 100$$

ですので、公平なディールであると言えます

2) 1200 ドルとなる確率が 20%になった場合

(20%の確率で 1200 ドルとなり、80%の確率で 1000 ドルとなる)

解答)

$$0.2 \times 1000 + 0.8 \times 0 = 200$$

ですので、プレミアムを更に 100 ドル払うことで公平なディールとなります。