



Производные ценные бумаги.э

- 1 Продавец опциона на продажу ведет игру на ...
- 2 При биржевой торговле опционами используется централизованный клиринг, то есть ...
- 3 Если ожидается падение цены базовой акции, то лучшим решением для получения прибыли будет ...
- 4 Если инвестор, 05 мая купивший на бирже опцион на покупку базовой акции со сроком окончания 31 августа, решит через месяц закрыть свою позицию, то ...
- 5 Утверждение, что в опционной сделке позиции покупателя и продавца опциона различны, ...
- 6 Утверждение, что величина опционного контракта, т.е. количество акций в одном опционе, уже учтена в котировальной цене опциона, ...
- 7 Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 рублей опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ рублей (рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, срок окончания опциона 10.02.2007 г.) и реализовал опцион 12 января 2007 года, то этот опцион надо отнести к ...
- 8 Утверждение, что текущая котировальная цена опциона колл представляет собой опционную премию по данному опциону, ...
- 9 Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 рублей опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ рублей (рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, срок окончания опциона 10.02.2007 г.), то при реализации опциона владельцем 25.10.2006 г., когда цена акций поднялась до 35 рублей, акции будет продавать ...
- 10 Европейский опцион на покупку долларов США на российские рубли (руб./доллар) является эквивалентом ...
- 11 Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 рублей опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ рублей (рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, срок окончания опциона 10.02.2007 г.), то в момент совершение данной сделки ...





- 12) Между инвесторами А и В заключается опционная сделка, согласно которой инвестор В обязан продать инвестору А 100 акций компании «Вега», если инвестор А примет решение реализовать опцион – в этом случае инвестор В является ...
- 13) Покупатель опциона на продажу ведет игру на ...
- 14) Если инвестор, купивший 05 мая на бирже опцион на продажу базовой акции со сроком окончания 31 августа, через месяц решит закрыть свою позицию, то он ...
- 15) Если инвестор приобрел опцион на покупку акции с ценой исполнения $K = 50$ руб. и в момент T окончания опциона рыночная цена базовой акции составит величину ST , то стоимость опциона составит ...
- 16) Если по базовой акции за время действия опциона выплачивается дивиденд, то стоимость европейского опциона на продажу в любой момент времени t необходимо ...
- 17) Отрицательная стоимость опциона ...
- 18) Если по базовой акции выплачиваются дивиденды, то американский опцион на покупку ...
- 19) Если в момент покупки опциона на покупку с ценой исполнения $K = 50$ руб. рыночная цена базовой акции также составила 50 руб., то стоимость данного опциона на покупку ...
- 20) Утверждение, что стоимость опциона на продажу в момент их исполнения, когда цена базовой акции составит величину ST , равняется большей из величин $(K-ST)$ или нулю, ...
- 21) Утверждение, что при прочих равных условиях американский опцион с более длительным сроком до окончания стоит дороже, чем опцион с более коротким сроком до окончания,
- 22) Утверждение, что американский опцион на акцию стоит всегда не дешевле, чем европейский опцион на эту же акцию, ...
- 23) Если имеются два опциона на покупку с одинаковым сроком окончания T и одинаковой базовой акцией, цена исполнения первого опциона $K_1 = 25$ руб., а второго опциона $K_2 = 40$ руб., то ...
- 24) В любой момент времени t стоимость европейского опциона на покупку ...
- 25) Если имеется опцион на продажу с ценой исполнения K руб., то можно утверждать, что стоимость такого опциона ...





- (26) Если имеется опцион на покупку с ценой исполнения K и безрисковая ставка процента составляет r процентов в год, а срок окончания опциона составляет 0,5 года, то при оценке цены опциона приведенная стоимость цены исполнения опциона ...
- (27) Если по базовой акции американского опциона на покупку не выплачиваются дивиденды, а непрерывно начисляемая ставка процента положительна, то такой опцион ...
- (28) Суммарную стоимость опциона в любой момент времени t можно представить как ...
- (29) Для оценки стоимости американских опционов формула Блэка-Шоулса ...
- (30) В любой момент времени t , если рыночная цена S_t базовой акции точно равняется цене реализации опциона K , то внутренняя стоимость опциона ...
- (31) Если по базовой акции за время действия опциона должен выплачиваться дивиденд, то формула Блэка-Шоулса в этом случае ...
- (32) В любой момент времени t , если рыночная цена S_t базовой акции точно равняется цене реализации опциона K , то полная стоимость опциона ...
- (33) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых срок окончания опциона ...
- (34) В основе биномиальной модели находится понятие репликантного портфеля, который формируется путем покупки ...
- (35) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых стандартное отклонение цены оцениваемого опциона ...
- (36) Простая биномиальная модель исходит из предположения, что в момент окончания опциона цена базовой акции ...
- (37) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых ожидаемая доходность рыночного портфеля ...
- (38) Если инвестор приобретет в репликантный портфель базовые акции в количестве, равном опционной дельте, то отдача репликатного портфеля будет ...





- 39) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых стоимость базовой акции в момент оценки опциона ...
- 40) Если биномиальная модель используется для оценки опциона за несколько шагов расчета, то оценку опциона надо проводить ...
- 41) Особенность использования биномиальной модели для оценки американских опционов на продажу состоит в том, что ...
- 42) Если инвестор использует при реализации инвестиционной стратегии «обеспеченный опцион на покупку» акции, то это означает, что ...
- 43) Чтобы реализовать стратегию «длинных ножниц», инвестор должен одновременно ...
- 44) Продажа обеспеченных опционов на покупку означает, что инвестор одновременно ...
- 45) Покупка обеспеченных опционов на продажу по характеру получаемой прибыли эквивалентна стратегии ...
- 46) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб, цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), тогда если через месяц цена базовой акции повысится до 120 руб. и срок действия опциона закончится, инвестор получит ...
- 47) Пусть инвестор купил обеспеченный опцион на продажу базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 9 руб.), тогда если через месяц срок действия опциона закончится, инвестор получит прибыль при условии, что цена базовой акции будет ...
- 48) Пусть инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.) тогда если через месяц цена базовой акции понизится до 50 руб. и в этот момент срок действия опциона закончится, то инвестор получит ...
- 49) Пусть инвестор купил обеспеченный опцион на продажу базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 9 руб.), тогда если через месяц цена базовой акции повысится до 120 руб. и в этот момент срок действия опциона закончится, то инвестор получит ...





- 50) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), а срок действия опциона заканчивается через один месяц – тогда чтобы инвестор получил прибыль при окончании опциона, необходимо, чтобы цена базовой акции ...
- 51) Если инвестор купил обеспеченный опцион на продажу базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 9 руб.), тогда если через месяц цена базовой акции понизилась до 50 руб. и в этот момент срок действия опциона закончится, то инвестор получит ...
- 52) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), а срок действия опциона заканчивается через один месяц, то чтобы инвестору была выгодна такая стратегия, необходимо, чтобы цена базовой акции...
- 53) Стратегия «покупка обеспеченных опционов на продажу» означает, что инвестор одновременно ...
- 54) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), то распределение случайных величин доходности обеспеченных опционов на покупку будет иметь...
- 55) Если инвестор одновременно продает опцион на покупку базовой акции и продает опцион на продажу этой же акции, а цена исполнения обоих опционов одинаковая, то инвестор ...
- 56) Вместо того чтобы использовать физическую поставку базового средства, большинство трейдеров на фьючерсном рынке предпочитают ...
- 57) Если участник фьючерсной сделки находится в короткой позиции, чтобы закрыть свою позицию, он должен ...
- 58) Инвесторы предпочитают торговать фьючерсными контрактами на товары, а не самими товарами, потому что ...
- 59) Утверждение, что продавец фьючерса в момент исполнения сделки обязан купить базовое средство по цене исполнения фьючерса, ...





- 60 Основным преимуществом фьючерса по сравнению с форвардом является то, что ...
- 61 Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 62 Участник фьючерсной сделки после получения маржинального требования должен депонировать на счет сумму, ...
- 63 Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 64 Роль клиринговых организаций в ходе фьючерсных торгов состоит в том, чтобы ...
- 65 Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 66 Если повышение цены базового средства приводит к тому, что участник фьючерсной сделки должен внести деньги на свой счет, то данный участник находится на фьючерсном рынке в ... позиции
- 67 Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 68 В форвардной сделке обязанной стороной по сделке является ...
- 69 Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 70 Продавец опциона на продажу ведет игру на ...
- 71 При биржевой торговле опционами используется централизованный клиринг, то есть ...
- 72 Если ожидается падение цены базовой акции, то лучшим решением для получения прибыли будет ...
- 73 Если инвестор, 05 мая купивший на бирже опцион на покупку базовой акции со сроком окончания 31 августа, решит через месяц закрыть свою позицию, то ...
- 74 Утверждение, что в опционной сделке позиции покупателя и продавца опциона различны, ...
- 75 Утверждение, что величина опционного контракта, т.е. количество акций в одном опционе, уже учтена в котировальной цене опциона, ...





- 76) Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 рублей опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ рублей (рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, срок окончания опциона 10.02.2007 г.) и реализовал опцион 12 января 2007 года, то этот опцион надо отнести к ...
- 77) Утверждение, что текущая котировальная цена опциона колл представляет собой опционную премию по данному опциону, ...
- 78) Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 рублей опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ рублей (рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, срок окончания опциона 10.02.2007 г.), то при реализации опциона владельцем 25.10.2006 г., когда цена акций поднялась до 35 рублей, акции будет продавать ...
- 79) Европейский опцион на покупку долларов США на российские рубли (руб./доллар) является эквивалентом ...
- 80) Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 рублей опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ рублей (рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, срок окончания опциона 10.02.2007 г), то в момент совершение данной сделки ...
- 81) Между инвесторами А и В заключается опционная сделка, согласно которой инвестор В обязан продать инвестору А 100 акций компании «Вега», если инвестор А примет решение реализовать опцион – в этом случае инвестор В является ...
- 82) Покупатель опциона на продажу ведет игру на ...
- 83) Если инвестор, купивший 05 мая на бирже опцион на продажу базовой акции со сроком окончания 31 августа, через месяц решит закрыть свою позицию, то он ...
- 84) Если инвестор приобрел опцион на покупку акции с ценой исполнения $K = 50$ руб. и в момент T окончания опциона рыночная цена базовой акции составит величину S_T , то стоимость опциона составит ...
- 85) Если по базовой акции за время действия опциона выплачивается дивиденд, то стоимость европейского опциона на продажу в любой момент времени t необходимо ...
- 86) Отрицательная стоимость опциона ...
- 87) Если по базовой акции выплачиваются дивиденды, то американский опцион на покупку ...





- 88) Если в момент покупки опциона на покупку с ценой исполнения $K = 50$ руб. рыночная цена базовой акции также составила 50 руб., то стоимость данного опциона на покупку ...
- 89) Утверждение, что стоимость опциона на продажу в момент их исполнения, когда цена базовой акции составит величину ST , равняется большей из величин $(K-ST)$ или нулю, ...
- 90) Утверждение, что при прочих равных условиях американский опцион с более длительным сроком до окончания стоит дороже, чем опцион с более коротким сроком до окончания,
- 91) Утверждение, что американский опцион на акцию стоит всегда не дешевле, чем европейский опцион на эту же акцию, ...
- 92) Если имеются два опциона на покупку с одинаковым сроком окончания T и одинаковой базовой акцией, цена исполнения первого опциона $K_1 = 25$ руб., а второго опциона $K_2 = 40$ руб., то ...
- 93) В любой момент времени t стоимость европейского опциона на покупку ...
- 94) Если имеется опцион на продажу с ценой исполнения K руб., то можно утверждать, что стоимость такого опциона ...
- 95) Если имеется опцион на покупку с ценой исполнения K и безрисковая ставка процента составляет r процентов в год, а срок окончания опциона составляет 0,5 года, то при оценке цены опциона приведенная стоимость цены исполнения опциона ...
- 96) Если по базовой акции американского опциона на покупку не выплачиваются дивиденды, а непрерывно начисляемая ставка процента положительна, то такой опцион ...
- 97) Суммарную стоимость опциона в любой момент времени t можно представить как ...
- 98) Для оценки стоимости американских опционов формула Блэка-Шоулса ...
- 99) В любой момент времени t , если рыночная цена St базовой акции точно равняется цене реализации опциона K , то внутренняя стоимость опциона ...
- 100) Если по базовой акции за время действия опциона должен выплачиваться дивиденд, то формула Блэка-Шоулса в этом случае ...
- 101) В любой момент времени t , если рыночная цена St базовой акции точно равняется цене реализации опциона K , то полная стоимость опциона ...





- 102) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых срок окончания опциона ...
- 103) В основе биномиальной модели находится понятие репликантного портфеля, который формируется путем покупки ...
- 104) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых стандартное отклонение цены оцениваемого опциона ...
- 105) Простая биномиальная модель исходит из предположения, что в момент окончания опциона цена базовой акции ...
- 106) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых ожидаемая доходность рыночного портфеля ...
- 107) Если инвестор приобретет в репликантный портфель базовые акции в количестве, равном опционной дельте, то отдача репликантного портфеля будет ...
- 108) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых стоимость базовой акции в момент оценки опциона ...
- 109) Если биномиальная модель используется для оценки опциона за несколько шагов расчета, то оценку опциона надо проводить ...
- 110) Особенность использования биномиальной модели для оценки американских опционов на продажу состоит в том, что ...
- 111) Если инвестор использует при реализации инвестиционной стратегии «обеспеченный опцион на покупку» акции, то это означает, что ...
- 112) Чтобы реализовать стратегию «длинных ножниц», инвестор должен одновременно ...
- 113) Продажа обеспеченных опционов на покупку означает, что инвестор одновременно ...
- 114) Покупка обеспеченных опционов на продажу по характеру получаемой прибыли эквивалентна стратегии ...
- 115) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб, цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), тогда если через месяц цена базовой акции повысится до 120 руб. и срок действия опциона закончится, инвестор получит ...





- 116) Пусть инвестор купил обеспеченный опцион на продажу базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 9 руб.), тогда если через месяц срок действия опциона закончится, инвестор получит прибыль при условии, что цена базовой акции будет ...
- 117) Пусть инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.) тогда если через месяц цена базовой акции понизится до 50 руб. и в этот момент срок действия опциона закончится, то инвестор получит ...
- 118) Пусть инвестор купил обеспеченный опцион на продажу базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 9 руб.), тогда если через месяц цена базовой акции повысится до 120 руб. и в этот момент срок действия опциона закончится, то инвестор получит ...
- 119) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), а срок действия опциона заканчивается через один месяц – тогда чтобы инвестор получил прибыль при окончании опциона, необходимо, чтобы цена базовой акции ...
- 120) Если инвестор купил обеспеченный опцион на продажу базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 9 руб.), тогда если через месяц цена базовой акции понизилась до 50 руб. и в этот момент срок действия опциона закончится, то инвестор получит ...
- 121) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), а срок действия опциона заканчивается через один месяц, то чтобы инвестору была выгодна такая стратегия, необходимо, чтобы цена базовой акции...
- 122) Стратегия «покупка обеспеченных опционов на продажу» означает, что инвестор одновременно ...





- 123) Если инвестор продал обеспеченный опцион на покупку базовой акции (в момент совершения сделки рыночная цена базовой акции составила 80 руб., цена исполнения опциона $K = 80$ руб., опционная премия равна 10 руб.), то распределение случайных величин доходности обеспеченных опционов на покупку будет иметь...
- 124) Если инвестор одновременно продает опцион на покупку базовой акции и продает опцион на продажу этой же акции, а цена исполнения обоих опционов одинаковая, то инвестор ...
- 125) Вместо того чтобы использовать физическую поставку базового средства, большинство трейдеров на фьючерсном рынке предпочитают ...
- 126) Если участник фьючерсной сделки находится в короткой позиции, чтобы закрыть свою позицию, он должен ...
- 127) Инвесторы предпочитают торговать фьючерсными контрактами на товары, а не самими товарами, потому что ...
- 128) Утверждение, что продавец фьючерса в момент исполнения сделки обязан купить базовое средство по цене исполнения фьючерса, ...
- 129) Основным преимуществом фьючерса по сравнению с форвардом является то, что ...
- 130) Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 131) Участник фьючерсной сделки после получения маржинального требования должен депонировать на счет сумму, ...
- 132) Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 133) Роль клиринговых организаций в ходе фьючерсных торгов состоит в том, чтобы ...
- 134) Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 135) Если повышение цены базового средства приводит к тому, что участник фьючерсной сделки должен внести деньги на свой счет, то данный участник находится на фьючерсном рынке в ... позиции
- 136) Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...
- 137) В форвардной сделке обязанной стороной по сделке является ...





138

Основное отличие фьючерса от форварда в том, что ...

Самый быстрый способ связи — мессенджер (кликни по иконке, и диалог откроется)



WhatsApp



Telegram



Max

Help@disynergy.ru | +7 (924) 305-23-08