



Рынок производных финансовых инструментов.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 Утверждение, что в опционной сделке позиции покупателя и продавца опциона ...
- 5 Пусть 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, а срок окончания опциона 10.02.2007 г., тогда если владелец опциона реализовал опцион 12 января 2007 года, этот опцион надо отнести к ... типу
- 6 Европейский опцион на покупку долларов США на российские рубли (руб./доллар) является эквивалентом ...
- 7 Если между инвесторами А и В заключается опционная сделка, согласно которой инвестор В обязан продать инвестору А 100 акций компании «Вега», и инвестор А примет решение реализовать опцион, то в этом случае инвестор В является ...
- 8 Покупатель опциона на продажу ведет игру на ...
- 9 Если инвестор 05 мая купил на бирже опцион на продажу базовой акции со сроком окончания 31 августа, а инвестор через месяц решит закрыть свою позицию, то ...
- 10 Если инвестор приобрел опцион на покупку акции с ценой исполнения $K = 50$ руб., а в момент T окончания опциона рыночная цена базовой акции составит величину S_T , то стоимость опциона составит ...
- 11 Отрицательная стоимость опциона ...
- 12 Если по базовой акции выплачиваются дивиденды, то американский опцион на покупку ...
- 13 Если в момент покупки опциона на покупку с ценой исполнения $K = 50$ руб. рыночная цена базовой акции также составила 50 руб., стоимость данного опциона на покупку ...





- 14) При прочих равных условиях американский опцион с более длительным сроком до окончания по сравнению с опционом с более коротким сроком до окончания ...
- 15) Если имеется опцион на покупку с ценой исполнения K , безрисковая ставка процента составляет r процентов в год, а срок окончания опциона полгода, то при оценке цены опциона приведенная стоимость цены исполнения опциона ...
- 16) Для оценки стоимости американских опционов формула Блэка-Шоулса ...
- 17) В любой момент времени t , если рыночная цена S_t базовой акции точно равняется цене реализации опциона K , то полная стоимость опциона ...
- 18) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых срок окончания опциона ...
- 19) В основе биномиальной модели находится понятие репликантного портфеля, который формируется путем покупки ...
- 20) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых стандартное отклонение цены оцениваемого опциона ...
- 21) Если инвестор использует при реализации инвестиционной стратегии «обеспеченный опцион на покупку» акции, то это означает, что ... для совершения сделки
- 22) Чтобы реализовать стратегию «длинных ножниц», инвестор должен одновременно ... этой же акции с одинаковой ценой исполнения
- 23) При стратегии «покупка обеспеченных опционов на продажу» инвестор одновременно ...
- 24) Если инвестор одновременно продает опцион на покупку базовой акции и продает опцион на продажу этой же акции, а цена исполнения обоих опционов одинаковая, тогда инвестор ...
- 25) Если сказано, что продавец фьючерса в момент исполнения сделки обязан купить базовое средство по цене исполнения фьючерса, то это означает, что ...
- 26) Основным преимуществом фьючерса по сравнению с форвардом является то, что ...
- 27) Одно из основных отличий фьючерса от форварда в том, что ...





- 28) Роль клиринговых организаций в ходе фьючерсных торгов состоит в том, чтобы ...
- 29) 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
- 30) В форвардной сделке обязанной стороной по сделке являет(ют)ся ...
- 31) Одно из основных отличий фьючерса от форварда в том, что ...
- 32) Одно из основных отличий фьючерса от форварда в том, что ...
- 33) Если инвестор приобрел опцион колл на фьючерсный контракт на акцию «Ростелекома» по цене исполнения K , то в случае реализации опциона он ... по фьючерсному контракту на акцию «Ростелекома» по цене K
- 34) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых ожидаемая доходность рыночного портфеля ...
- 35) Для того чтобы применить на практике формулу Блэка-Шоулса, необходимо учитывать ряд параметров, среди которых параметров стоимость базовой акции в момент оценки опциона ...
- 36) Если биномиальная модель используется для оценки опциона за несколько шагов расчета, то оценку опциона надо проводить ...
- 37) Особенность использования биномиальной модели для оценки американских опционов на продажу состоит в том, что ...
- 38) Если инвестор 05 мая купил на бирже опцион на покупку базовой акции со сроком окончания 31 августа и через месяц решил закрыть свою позицию, то он ...
- 39) Величина опционного контракта, т.е. количество акций в одном опционе, ...
- 40) Текущая котировальная цена опциона колл ...
- 41) Если инвестор 27.09.2006 г. купил за 500 руб. опцион на покупку 100 акций с ценой исполнения опциона $K = 26$ руб., рыночная цена акций в этот момент была 20 рублей, а срок окончания опциона 10.02.2007 г., и если известно, что 25.10.2006 г. цена акций поднялась до 35 руб., то при реализации опциона владельцем в этот день продавать будет ...





- 42) 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, а срок окончания опциона 10.02.2007 г., то в момент совершение данной сделки ...
- 43) Если по базовой акции за время действия опциона выплачивается дивиденд, то стоимость европейского опциона на продажу в любой момент времени t необходимо ...
- 44) 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 тогда ...
- 45) Если инвестор приобретет в репликантный портфель базовые акции в количестве, равном опционной дельте, то отдача репликатного портфеля будет ... при любых изменениях цены базовой акции
- 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., и известно, что через один месяц цена базовой акции повысилась до 120 руб., то тогда если в этот момент срок действия опциона закончится, инвестор получит ...
- 47) 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., а опционная премия равна 9 руб., и известно, что через один месяц срок действия опциона закончится, то инвестор получит прибыль, если цена базовой акции будет ...
- 48) 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., а опционная премия равна 9 руб., и известно, что через один месяц цена базовой акции повысилась до 120 руб., то если в этот момент срок действия опциона закончится, инвестор получит ...
- 49) Вместо того чтобы использовать физическую поставку базового средства, большинство трейдеров на фьючерсном рынке предпочитают ...
- 50) Инвесторы предпочитают торговать фьючерсными контрактами на товары, а не самими товарами, потому что ...
- 51) Участник фьючерсной сделки после получения маржинального требования должен депонировать на счет сумму, ...





- 52) Если инвестор 20.04.05 г. приобрел на первичном рынке за 10 руб. опцион на покупку акций «Веги» с ценой исполнения 60 руб., в момент заключения сделки рыночная цена базовой акции составляла 45 руб., срок окончания опциона 20.10.05 г., то тогда при условии, что 19.10.05 г. рыночная цена базовой акции составит 55 рублей, то реализовывать опцион его владельцу ...
- 53) Если инвестор 20 марта 2006 года приобрел опцион на продажу акции фирмы «Вега», когда рыночная стоимость основной акции составляла 25 рублей, цена исполнения опциона 20 рублей, опционная премия – 4 рубля, то чтобы инвестор получил от данной сделки доходность в 100%, цена базовой акции должна ...
- 54) Если инвестор 20 марта 2006 года приобрел опцион на продажу акции фирмы «Вега», когда рыночная стоимость основной акции составляла 25 рублей, цена исполнения опциона 20 рублей, опционная премия – 4 рубля, то инвестор может получить от этой сделки максимальную доходность ...
- 55) Пусть инвестор приобрел опцион колл на фьючерс на Индекс РТС с ценой реализации 182000 пунктов и сроком окончания 14.06.2007 г., тогда если в момент окончания опциона Индекс РТС достигнет величины 1850 пунктов, а инвестор не примет решения о реализации опциона, то ...
- 56) В любой момент времени t , если рыночная цена S_t базовой акции точно равняется цене реализации опциона K , то внутренняя стоимость опциона ...
- 57) Покупка обеспеченных опционов на продажу по характеру получаемой прибыли эквивалентна ...

