

MODERNIOSIOS FINANSŲ RINKOS TEORIJOS PAGRINDAI

Klausimai atsiskaitymui už 2006 metų rudens kurso pirmąją pusę

Rimas Norvaiša

E-paštas: norvaisa@ktl.mii.lt

Vilnius, 2006 lapkritis

Du klausimai: po vieną klausimą iš pirmojo ir antrojo skyrių.

1. Kas yra finansų rinka ir koks yra jos vaidmuo finansų sistemoje?
 2. Iš kur atsiranda rizika finansų rinkoje ir kaip ji atsispindi skirtinguose vertybiniuose popieriuose?
 3. Pagal kokius aspektus skirstomi vertybiniai popieriai ir kokias žinote jų rūšis?
 4. Kokie yra nerizikingų vertybinių popierių pavyzdžiai ir kokia jų nauda?
 5. Kas yra dabartinė vertė ir kokius žinote jos taikymo pavyzdžius?
 6. Kas yra pilnas pelningumas ir kaip jis skaičiuojamas?
 7. Kas yra palūkanos ir kokias žinote palūkanų rūšis?
 8. Kas yra racionalių lūkesčių hipotezė?
 9. Kas yra efektyviosios rinkos hipotezė?
-
1. Ką žinote apie matematinį finansų rinkos modeliavimą?
 2. Ką žinote apie akcijos kainos ir gražos modeliavimą diskretaus laiko atveju?
 3. Kas yra sąžiningo lošimo rinka ir kokia savybe pasižymi diskontuotas kainos procesas tokioje rinkoje?
 4. Kas yra fundamentalioji vertė ir koks yra jos ryšys su sąžiningo lošimo hipoteze?
 5. Kas yra binominis rinkos modelis ir koks jos ryšys su atsitiktinio klaidžiojimo hipoteze?
 6. Kas yra Wienerio procesas ir ką žinote apie jo svarbą finansų rinkos modeliavimui?
 7. Kas yra funkcijos p -variacija ir kvadratinė λ -variacija, kuo jos svarbios finansų rinkos modeliavimui?
 8. Kas yra geometrinis Wienerio procesas ir kokį žinote jo apibrėžimo motyvą?
 9. Ką galite pasakyti apie akcijos gražos modeliavimą tolydaus laiko modelyje?