

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

1. Дельта-хеджирование
2. Практические методики оценки кредитного риска
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 2

1. Азиатские опционы
2. Оценка VaR портфеля, включающего деривативы
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 3

1. Стоимость европейского опциона пут
2. Колебания волатильности
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 4

1. Детерминированная модель временной структур процентных ставок
2. Риск-менеджмент при помощи деривативов
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 5

1. Модель Блэка-Шоулса
2. Задача оценки и хеджирования
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 6

1. Коэффициент тэта
2. Использование деривативов и комбинаций деривативов для риск-менеджмента
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 7

1. Финансовые производные
2. Оценка права обменять один актив на другой
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 8

1. Кэпы
2. Страхование портфелей
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 9

1. Гамма-хеджирование
2. Стандартные комбинации и опционные стратегии
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 10

1. Определение цен финансовых активов
2. Коллары
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 11

1. Форвардные и фьючерсные цены
2. Облигации со встроенными опционами
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 12

1. Опцион на обмен активами
2. Кредитный риск
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 13

1. Определение цены облигации
2. Процентные финансовые инструменты
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 14

1. Стоимость европейского опциона колл
2. Флоры
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 15

1. Коэффициент rho
2. Опционы на купонные облигации
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 16

1. Коэффициент вега
2. Свопционы
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 17

1. Опцион на обмен активами
2. Кредитный риск
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 18

1. Бинарные опционы
2. Учет кредитного риска в ценах корпоративных бумаг
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 19

1. Барьерные опционы
2. Не зависящие от волатильности цены
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.

СевГУ

Специальность 38.04.08 – Финансы и кредит

Семестр 3

Учебная дисциплина «Математическое обеспечение финансовых решений»

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 20

1. Бермудские опционы
2. Процентные свопы
3. Задача

Утверждены на заседании кафедры Финансов и кредита

_____ протокол № 4 от 03 декабря 2015 г.

Зав. кафедрой Вожжов А.П. Экзаменатор Хохлов В.В.