

Obligatorisk oppgave høst 2010

Problemstilling Ta for deg situasjonen i Exercise 3.6.5 og legg til grunn de samme betingelsene som der bortsett fra at du lar renten r variere mellom 0%, 3% og 6% og tidshorisonten K mellom ett, fire og åtte år. Når det gjelder fler-periode reservering (“ruinproblemet”) benytt deg av Exercise 3.6.7.

Rapport Du skal skrive en kort rapport, redgjøre for forutsetningene, demonstrere hvorledes nettoverdien \mathcal{Y}_k utvikler seg med tiden (gjerne gjennom er simultan-plot av flere simuleringer) og vise gjennom en tabell hvorledes en reserve som skal holde over flere år avhenger av rente r og tidshorisont K . Velg reserveringsprosent ϵ og antall simuleringer selv.

Innlevering Leveres på papir til Erik Bølviken senest mandag 9. november klokken 16.00 (rett etter forelesning). Du kan også bruke hans postkasse i 7. etasje i Abel (“matematikkbygningen”). Hvis tekstbehandling ikke er praktisk for deg, kan du skrive for hånd, men håndskriften må være leselig! En av de tingene du skal lære noe om gjennom den obligatoriske oppgaven er rapport-skriving og den siden vil bli diskutert på øvelsene tirsdag 10 november. For få oppgaven godkjent må du legge noe arbeid i en forståelig presentasjon.