

Vraag	Antwoord	Scores
-------	----------	--------

Financieel risico

15 maximumscore 4

- Het aflezen van de frequenties 1, 0, 4, 3, 9, 12, 21, 23, 32, 36, 43 en 58 2
- Dat geeft een totaal van 242 maandopbrengsten 1
- Het antwoord: 24% (of nauwkeuriger) 1

16 maximumscore 3

- Er moet gelden $P(X < g \mid \mu = 752; \sigma = 2500) = 0,01$ 1
- Beschrijven hoe de waarde van g met de GR berekend kan worden 1
- Het antwoord: -5064 (dus 5064 euro verlies of meer) 1

17 maximumscore 5

- $\mu_{10\text{dagen}} = 380\,000 \cdot 10 = 3\,800\,000$ (euro) 1
- $\sigma_{10\text{dagen}} = 1,4 \cdot \sqrt{10} \cdot 10^6$ ($\approx 4\,430\,000$ (euro)) (of nauwkeuriger) 1
- De waarde van g in $P(X < g \mid \mu = 3\,800\,000; \sigma = 1,4\sqrt{10} \cdot 10^6) = 0,01$ moet berekend worden 1
- De waarde van g is $-6,5 \cdot 10^6$ (euro) (of nauwkeuriger) 1
- Het vereiste kapitaal is $6,5 \cdot 10^6 \cdot 3 = 19,5 \cdot 10^6$ (of 19,5 miljoen) (euro) (of nauwkeuriger) 1

Opmerking

Als de standaardafwijking van 10 dagen onjuist is berekend, maximaal 3 scorepunten toekennen.

18 maximumscore 4

- Het aantal X dat niet terugbetaalt is binomiaal verdeeld met $n = 260$ en $p = 0,40$ 1
- Berekend moet worden $P(X > 130)$ 1
- Beschrijven hoe deze kans met de GR berekend kan worden 1
- Het antwoord: 0,0004 1