

教室番号

--

( 火 3 )

# 青 山 学 院 大 学

前 ・ ② 後 期 試 験

2003 年 2 月 4 日 3 時限実施

(注意) ・ 答案は必ず提出すること。

授業科目	統計学概論	学 生 番 号	学 科	学 年	組	番	フリガナ	評 点
担当者	白木 善尚						氏 名	

問 1. ブラックショールズ方程式に関わる事項を一つ選び、その事項について簡潔にかつできるだけ詳しく解説説明しなさい。

問 2. ブラックショールズ方程式はどのようにして導出されるのか。伊藤の公式、及びポートフォリオの二つの言葉を含んだ文章で簡潔にかつできるだけ詳しく解説説明しなさい。

問 3. 統計的推測における確率分布の役割を述べよ。

問 4. 標本平均  $\bar{X}$ 、標本標準偏差  $\sigma_{n-1}$  を求めた上で  
 4-1. 95%有意水準の信頼区間を求める問題(略)  
 4-2. 99%有意水準の信頼区間を求める問題(略)

問 5. 標本平均  $\bar{X}$ 、標本標準偏差  $\sigma_{n-1}$  を求めた上で  
 5-1. 有意水準 0.2 (80%の信頼区間) における検定(略)  
 5-2. 有意水準 0.01 (99%の信頼区間) における検定(略)

備考.  
 問題用紙 (No.1)  
 正規分布表と  $t$  分布表がセットにされたプリント (No.2)  
 解答用紙 (No.3)  
 3 枚とも全て提出