

Exam Trading & Exchanges january 2019

Bewijs van inventory models met startvoorraad + de bid, ask, midquote en spread uitleggen.

Bewijs: the immediate price impact of inventory gradually decreases and eventually completely dissipates.

Deel 2.6 empirical models het eerste model elke vergelijking uitleggen en uiteindelijk de vergelijking waarbij de kans op een tekenswitch in rekening werd gehouden bewijzen.

Voor- en nadelen van Market orders en limit orders geven

Bewijs van cutoff betas met uitleg

Bewijs aan de hand van lemma's dat $PR(LO_{sell} | MO_{sell}) < PR(LO_{sell} | MoBuy)$

Bewijs dat de snelheid van price discovery afhangt van de proportie aan informed traders in de markt

Dark pools: resultaten van studie uit 2014 uitleggen

Zelf een empirisch model proberen opstellen dat je bevindingen uit 8 zouden kunnen aantonen