

YLIOPISTOTENTTI - UNIVERSITY EXAM

Opiskelijan nimi / Student name:	Opiskelijanumero / Student number:
---	---

Opettaja täyttää / Lecturer fills in:

Opintojakson koodi and nimi / The code and the name of the course:		
Koodi / Code	721383S	
Tentin nimi / Exam name	<i>Asset Pricing</i>	
Tiedekunta / Faculty: OYKKK / OBS		
Tentin pvm / Date of exam: 25.8.2017	Tentin kesto tunteina / Exam in hours: 3 h	
Tentin numero / No. of the exam: kesätentti	Opintopistemäärä / Credit units: 6	
Tentaattori(t) / Examiner(s):	Sisäinen postios. / Internal address:	
Hannu Kahra	6 OYKKK	
Sallitut apuvälineet / The devices allowed in the exam:		
<input checked="" type="checkbox"/> Nelilaskin / Standard calculator	<input checked="" type="checkbox"/> Funktiolaskin / Scientific calculator	<input type="checkbox"/> Ohjelmoitava laskin / Programmable calculator
<input type="checkbox"/> Muu materiaali, tarkennettu alla / Other material, specified below:		
Tenttiin vastaaminen / Please answer the questions:		
<input checked="" type="checkbox"/> Suomeksi / in Finnish	<input checked="" type="checkbox"/> Englanniksi / in English	
Suomenkielisessä tutkinto-ohjelmassa olevalla opiskelijalla on oikeus käyttää arvioitavassa opintosuorituksessa suomen kieltä, vaikka opintojakson opetuskieli olisi englanti. Tämä ei koske vieraan kielen opintoja. (Kts. <u>Koulutuksen johtosääntö 18 §</u>)		
In a Finnish degree programme a student has a right to use Finnish language for their study attainment, even though the language of instruction is English, (excluding language studies) even when the language of instruction is other than Finnish. (See <u>the Education Regulations 18 §</u>)		
Kysymyspaperi on palautettava / Paper with exam questions must be returned:		
<input type="checkbox"/> Kyllä / Yes	<input checked="" type="checkbox"/> Ei / No	

1. *Consumption based asset pricing model (CCAPM)*
2. *Define the following factors*
 - *SMB*
 - *HMB*
 - *Momentum*
3. *Time-series predictability*
4. *Old and new facts in finance*