



## Инвестиционный анализ.

- 1 Поступающая на рынок ценных бумаг информация ...
- 2 В модели Г. Марковица предполагается, что ...
- 3 Под «ожидаемой доходностью » отдельной акции в модели Г. Марковица понимается ...
- 4 Ковариация доходностей двух акций портфеля ...
- 5 Если веса акций портфеля положительные, то ожидаемая доходность портфеля...
- 6 Дисперсия инвестиционного портфеля принимать отрицательное значение ...
- 7 Если инвестор намерен оценить доходность акции за будущий холдинговый период с помощью ожидаемой доходности и с этой целью он выбрал 8 шагов расчета в прошлом, за которые намерен вычислить доходность  $t$  этой акции, то для вычисления брать шаги расчета различной длительности ...
- 8 Если инвестор намерен оценить ожидаемую доходность акции за холдинговый период и для этого он выбрал шагов в прошлом, высчитал доходность акции за каждый шаг расчета и нашел , то ситуация, в которой будет отрицательной величиной, ...
- 9 Суть теоремы Г. Марковица о существовании границы эффективных портфелей (ГЭП) сводится к тому, что ...
- 10 Согласно модели Марковица, граница эффективных портфелей – это ...
- 11 Систематическим риском можно считать долю риска, ...
- 12 Если в модели Марковица ожидаемая доходность портфеля является средневзвешенной величиной доходности входящих в портфель ценных бумаг, то в общем случае риск портфеля ...
- 13 Решая задачу Г. Марковица по построению границы эффективных портфелей, инвестор должен в конечном итоге вычислить ... портфеля
- 14 Оптимальный портфель ...



- 15 Утверждение, что коэффициент регрессионной модели может свидетельствовать о степени чувствительности доходности конкретной акции к изменениям рынка, ...
- 16 Сокращение объемов вычислений в модели У. Шарпа объясняется тем, что ...
- 17 Для придания компактности формулам, с помощью которых строится граница эффективных портфелей, У. Шарп предложил ввести понятие  $(n+1)$ -ой акции портфеля, под которой понимается ...
- 18 Если для какой-то акции коэффициент  $B$  оказывается меньше нуля, то коэффициент в этом случае ...
- 19 Коэффициент «альфа» – это ...
- 20 Ситуация, когда коэффициенты  $a$  и  $B$  в модели Шарпа будут одновременно положительными величинами, ...
- 21 Одним из условий эффективности рынка ценных бумаг по теории Марковица является ...
- 22 Стандартное отклонение в теории Марковица используется для оценки ...
- 23 Сумма всех весов акций в портфеле должна быть ...
- 24 Выделяют следующие виды управления инвестиционным портфелем: ...
- 25 Если инвестор для формирования композиционных портфелей использует эффективный портфель, содержащий 40 акций, а также может использовать как приобретение безрисковых ценных бумаг, так и заем по ставке , и если известно, что ГЭП в обоих этих случаях становится прямой линией, то утверждать, что для данных композиционных портфелей ГЭП в случае безрискового суживания и ГЭП для безрискового займа будут лежать на одной прямой линии, ...
- 26 Ликвидность и риск ...
- 27 Доходность и риск связаны ... зависимостью
- 28 Утверждать, что при соблюдении начальных условий модели САРМ каждый инвестор будет стремиться создавать рисковую часть композиционных портфелей на основе рыночного портфеля  $M$ , ...



- 29 Для вычисления а и В регрессионной модели используется метод наименьших квадратов, в соответствии с которым ...
- 30 Безрисковым средством в модели CAPM обычно выступает ...

