



Портфельное инвестирование.э

- 1) Если инвестор располагает 25 акциями Газпрома, 10 векселями Сбербанка и 15 облигациями сберегательного займа, то считать, что он сформировал портфель ценных бумаг ...
- 2) Выбрать тип ценных бумаг для их включения в портфель можно по степени риска и ...
- 3) Если инвестор сформировал портфель роста, то ...
- 4) Если инвестор сформировал портфель из государственных облигаций с целью получения стабильного дохода, то по склонности к риску такого инвестора, скорее всего, можно отнести к типу ...
- 5) Эффективному рынку ценных бумаг в контексте модели Г. Марковица присуще свойство ...
- 6) Поступающая на рынок ценных бумаг информация ...
- 7) В модели Г. Марковица предполагается, что ...
- 8) Под ожидаемой доходностью $E(r)$ отдельной акции в модели Г. Марковица понимается ...
- 9) Ковариация доходностей двух акций портфеля ...
- 10) Если веса акций портфеля положительные, то ожидаемая доходность портфеля...:
- 11) Дисперсия портфеля принимать отрицательное значение ...
- 12) Инвестор намерен оценить доходность акции за будущий холдинговый период с помощью ожидаемой доходности $E(r)$. С этой целью он выбрал 8 шагов расчета в прошлом, за которые намерен вычислить доходность r_t этой акции. Для вычисления $E(r)$ брать шаги расчета различной длительности ...
- 13) Инвестор намерен оценить ожидаемую доходность $E(r)$ акции за холдинговый период. Для этого он выбрал $N = 10$ шагов в прошлом, высчитал доходность акции за каждый шаг расчета и нашел $E(r)$. Ситуация в которой $E(r)$ будет отрицательной величиной ...





- 14) Предположим, что $\sigma = 10\%$, а $E(r) = 3\%$, т.е. стандартное отклонение доходности какой-то акции по абсолютной величине превосходит ее ожидаемую доходность $E(r)$. Такая ситуация ...
- 15) Инвестор оценивает возможность построения портфеля из 10 акций и портфеля из 230 акций. Утверждать, что если для первого портфеля инвестор в состоянии построить границу эффективных портфелей (ГЭП), то и для второго портфеля эта задача разрешима ...
- 16) Инвестор выбрал n акций и путем перебора их весов построил зону существования портфелей. Ситуация, чтобы для какого-то портфеля, сформированного из этих акций, соответствующая точка на координатной плоскости $[\sigma; E(r)]$ лежала вне данной зоны ...
- 17) Суть теоремы Г. Марковица о существовании ГЭП сводится к тому, что ...
- 18) Согласно модели Г. Марковица граница эффективных портфелей - это ...
- 19) Систематическим риском можно считать долю риска, ...
- 20) Если ожидаемая доходность портфеля является средневзвешенной величиной доходности входящих в портфель ценных бумаг, то в общем случае риск портфеля взвешенной средней величине дисперсий доходности ценных бумаг портфеля ...
- 21) Путем диверсификации ...
- 22) Решая задачу Г. Марковица по построению границы эффективных портфелей в конечном итоге, инвестор должен вычислить ...
- 23) Заданному уровню риска единственная точка на границе эффективных портфелей соответствует...
- 24) Утверждение Оптимальный портфель обязательно должен быть эффективным ...
- 25) Известно, что в основе метода У. Шарпа лежит метод линейного регрессионного анализа. Уравнение линейной регрессии в данной модели связывает ...
- 26) Ситуация, когда для какой-то акции A значение коэффициента $\beta = 1,7$...





- 27) Утверждение, что коэффициент регрессионной модели может свидетельствовать о степени чувствительности доходности конкретной акции к изменениям рынка ...
- 28) Для нахождения коэффициентов и регрессионной модели используется метод наименьших квадратов. Это означает, что при вычислении данных коэффициентов необходимо, чтобы ...
- 29) Принцип вычисления коэффициентов и регрессионной модели заключается в том, чтобы...:
- 30) Ситуация, когда коэффициенты a и b для одной и той же акции одновременно становятся отрицательными, ...
- 31) Если случайная ошибка в регрессионном уравнении является случайной величиной, то ее средняя арифметическая величина принимать отрицательное значение ...
- 32) Ситуация, когда при составлении регрессионного уравнения в модели У. Шарпа для какой-то акции i получилось, что ожидаемая величина случайной ошибки ...
- 33) В общем случае ожидаемая доходность случайной ошибки любой акции портфеля. Тогда утверждать, что и дисперсия случайной ошибки для любой акции портфеля в модели Шарпа также равна нулю в общем случае ...
- 34) Сокращение объемов вычислений в модели У. Шарпа объясняется тем, что ...
- 35) Портфельная бета ...
- 36) Для придания компактности формулам, с помощью которых строится граница эффективных портфелей, У. Шарп предложил ввести понятие $(n+1)$ -ой акции портфеля. Под этой акцией понимается ...
- 37) Под весом $(n+1)$ -ой акции портфеля в модели У. Шарпа подразумевается ...
- 38) Если имеются две акции А и В со следующими характеристиками: , то можно утверждать, что ...
- 39) На графике граница эффективных портфелей в модели Шарпа строится в координатах, которые являются...:
- 40) Если для какой-то акции коэффициент бета оказывается меньше нуля, то коэффициент альфа в этом случае...





- 41) Если инвестор располагает 25 акциями Газпрома, 10 векселями Сбербанка и 15 облигациями сберегательного займа, то считать, что он сформировал портфель ценных бумаг ...
- 42) Выбрать тип ценных бумаг для их включения в портфель можно по степени риска и ...
- 43) Если инвестор сформировал портфель роста, то ...
- 44) Если инвестор сформировал портфель из государственных облигаций с целью получения стабильного дохода, то по склонности к риску такого инвестора, скорее всего, можно отнести к типу ...
- 45) Эффективному рынку ценных бумаг в контексте модели Г. Марковица присуще свойство ...
- 46) Поступающая на рынок ценных бумаг информация ...
- 47) В модели Г. Марковица предполагается, что ...
- 48) Под ожидаемой доходностью $E(r)$ отдельной акции в модели Г. Марковица понимается ...
- 49) Ковариация доходностей двух акций портфеля ...
- 50) Если веса акций портфеля положительные, то ожидаемая доходность портфеля...:
- 51) Дисперсия портфеля принимать отрицательное значение ...
- 52) Инвестор намерен оценить доходность акции за будущий холдинговый период с помощью ожидаемой доходности $E(r)$. С этой целью он выбрал 8 шагов расчета в прошлом, за которые намерен вычислить доходность r_t этой акции. Для вычисления $E(r)$ брать шаги расчета различной длительности ...
- 53) Инвестор намерен оценить ожидаемую доходность $E(r)$ акции за холдинговый период. Для этого он выбрал $N = 10$ шагов в прошлом, высчитал доходность акции за каждый шаг расчета и нашел $E(r)$. Ситуация в которой $E(r)$ будет отрицательной величиной ...
- 54) Предположим, что $\sigma = 10\%$, а $E(r) = 3\%$, т.е. стандартное отклонение доходности какой-то акции по абсолютной величине превосходит ее ожидаемую доходность $E(r)$. Такая ситуация ...





- 55) Инвестор оценивает возможность построения портфеля из 10 акций и портфеля из 230 акций. Утверждать, что если для первого портфеля инвестор в состоянии построить границу эффективных портфелей (ГЭП), то и для второго портфеля эта задача разрешима ...
- 56) Инвестор выбрал n акций и путем перебора их весов построил зону существования портфелей. Ситуация, чтобы для какого-то портфеля, сформированного из этих акций, соответствующая точка на координатной плоскости $[\sigma ; E(r)]$ лежала вне данной зоны ...
- 57) Суть теоремы Г. Марковица о существовании ГЭП сводится к тому, что ...
- 58) Согласно модели Г. Марковица граница эффективных портфелей - это ...
- 59) Систематическим риском можно считать долю риска, ...
- 60) Если ожидаемая доходность портфеля является средневзвешенной величиной доходности входящих в портфель ценных бумаг, то в общем случае риск портфеля взвешенной средней величине дисперсий доходности ценных бумаг портфеля ...
- 61) Путем диверсификации ...
- 62) Решая задачу Г. Марковица по построению границы эффективных портфелей в конечном итоге, инвестор должен вычислить ...
- 63) Заданному уровню риска единственная точка на границе эффективных портфелей соответствует...
- 64) Утверждение Оптимальный портфель обязательно должен быть эффективным ...
- 65) Известно, что в основе метода У. Шарпа лежит метод линейного регрессионного анализа. Уравнение линейной регрессии в данной модели связывает ...
- 66) Ситуация, когда для какой-то акции A значение коэффициента = 1,7 ...
- 67) Утверждение, что коэффициент регрессионной модели может свидетельствовать о степени чувствительности доходности конкретной акции к изменениям рынка ...





- 68) Для нахождения коэффициентов и регрессионной модели используется метод наименьших квадратов. Это означает, что при вычислении данных коэффициентов необходимо, чтобы ...
- 69) Принцип вычисления коэффициентов и регрессионной модели заключается в том, чтобы...:
- 70) Ситуация, когда коэффициенты a и b для одной и той же акции одновременно становятся отрицательными, ...
- 71) Если случайная ошибка в регрессионном уравнении является случайной величиной, то ее средняя арифметическая величина принимать отрицательное значение ...
- 72) Ситуация, когда при составлении регрессионного уравнения в модели У. Шарпа для какой-то акции i получилось, что ожидаемая величина случайной ошибки ...
- 73) В общем случае ожидаемая доходность случайной ошибки любой акции портфеля. Тогда утверждать, что и дисперсия случайной ошибки для любой акции портфеля в модели Шарпа также равна нулю в общем случае ...
- 74) Сокращение объемов вычислений в модели У. Шарпа объясняется тем, что ...
- 75) Портфельная бета ...
- 76) Для придания компактности формулам, с помощью которых строится граница эффективных портфелей, У. Шарп предложил ввести понятие $(n+1)$ -ой акции портфеля. Под этой акцией понимается ...
- 77) Под весом $(n+1)$ -ой акции портфеля в модели У. Шарпа подразумевается ...
- 78) Если имеются две акции А и В со следующими характеристиками: , то можно утверждать, что ...
- 79) На графике граница эффективных портфелей в модели Шарпа строится в координатах, которые являются...:
- 80) Если для какой-то акции коэффициент бета оказывается меньше нуля, то коэффициент альфа в этом случае...

