



## Управление инвестиционным портфелем.м

- 1 В теории и практике управления портфелем существует два подхода: традиционный и современный; родоначальником современной портфельной теории считается ...
- 2 Патенты, лицензии, права пользования, авторские права, товарные знаки задействованы в ... инвестициях
- 3 ... инвестиции – вложения в уставной капитал хозяйствующего субъекта с целью извлечения дохода и получения прав на участие в управлении данным хозяйствующим субъектом
- 4 К финансовым инвестициям, в частности, относят ...
- 5 Принцип ... предусматривает достижение минимизации риска за счет включения в портфель ценных бумаг широкого круга отраслей, не связанных тесно между собой, чтобы избежать синхронности циклических колебаний их деловой деятельности
- 6 ... не используют операции на фондовом рынке как основной источник текущего дохода, а применяют их преимущественно для увеличения капитала
- 7 В основе поведения ... на фондовом рынке лежат средне- и долгосрочная стратегии, средства инвестируются на значительные сроки, а основным результатом является получение высокой, но при этом обязательно гарантированной доходности
- 8 Высокий уровень левериджа ...
- 9 Выделяют две категории акций: ...
- 10 Стоимость первичного размещения акций – это ... цена
- 11 Путем деления уставного капитала на количество выпущенных акций определяется ... цена акции
- 12 Ставка дивиденда записывается в ...
- 13 Облигация может выпускаться на минимальный срок не более ... лет
- 14 Разность между ценой облигации, если она выше номинала, и номиналом называется ...



- (15) Изменение цены облигации измеряется в ...
- (16) Доходность облигации измеряется в ...
- (17) Процесс управления инвестиционным портфелем, в частности, включает этап ...
- (18) Рынок имеет среднюю форму эффективности, если цена актива отражает ... информацию, касающуюся данного актива
- (19) При средней форме эффективности рынка ... обеспечить сверхприбыль
- (20) Инвестиционные решения принимаются на основании оценки двух параметров: ожидаемой доходности и риска; при заданном уровне ожидаемой доходности инвесторы отдадут предпочтение портфелю с ... риском
- (21) Согласно модели Марковица, значение доходности акции ...
- (22) В качестве меры риска принято использовать ... отклонение
- (23) Ожидаемая доходность портфеля это ... доходностей включенных ценных бумаг
- (24) Коэффициент корреляции измеряется в ...
- (25) Ковариация доходностей двух акций портфеля ...
- (26) Положительное значение коэффициента корреляции говорит о том, что при изменении конъюнктуры ...
- (27) Если коэффициент корреляции акций в портфеле  $-1$ , то ...
- (28) Эффективный набор портфелей – это набор, состоящий из ... портфелей
- (29) Метод линейного регрессионного анализа лежит в основе ...
- (30) Чем дольше период, в течение которого инвестор собирается владеть акциями, тем ...
- (31) Классификацию стратегий управления портфелем можно разбить на две основные категории: ...
- (32) Основных форм активного управления портфелем ...



- (33) Пассивные портфели характеризуются ...
- (34) ... это портфель, созданный для зеркального отражения движения выбранного индекса, характеризующего состояние всего рынка ценных бумаг
- (35) Суть метода сдерживания портфелей заключается в ...
- (36) Иммунизация портфеля дает ... изменений в процентных ставках
- (37) Коэффициент ... учитывает доходность портфеля, полученную сверх ставки без риска, и весь риск, как систематический, так и не систематический
- (38) В коэффициенте Трейнора мерой риска выступает ...
- (39) Индекс Дженсена используется для оценки результатов ... стратегии
- (40) Индекс Дженсена представляет собой ...
- (41) Неверно, что оценка эффективности выбранной стратегии может осуществляться с помощью ...

