



Управление инвестиционным портфелем.oi(dor)

- 1 Если инвестор осуществляет активный поиск инвестиционных идей, то в общем случае такое его поведение можно отнести к ... стилю управления
- 2 Сокращение объемов вычислений в модели У. Шарпа объясняется тем, что ...
- 3 Согласно модели Г. Марковица «граница эффективных портфелей» – это ...
- 4 Инвестор при формировании рискованного портфеля из 5 акций решил занять 10000 руб. по безрисковой ставке 6%, и это решение можно считать ...
- 5 Модель с «нулевой бетой» появляется в случае, если ...
- 6 Способ снижения инвестиционного риска посредством заключения сделок с производными финансовыми инструментами – это ...
- 7 Принципом формирования инвестиционного портфеля является ...
- 8 Совокупность нескольких инвестиционных объектов, которая управляется как единый инвестиционный объект ради получения прибыли или достижения иного положительного эффекта – это ... портфель
- 9 Портфель, в который инвестор включает ценные бумаги компаний-эмитентов, работающих в области высоких технологий, можно отнести к ... портфелю
- 10 Ликвидность и риск инвестиционного портфеля ...
- 11 Пересмотр и корректировка состава и структуры портфеля с учетом изменяющейся внешней среды и целей инвестора – это ... инвестиционного портфеля
- 12 Сумма весов всех акций портфеля ...
- 13 Портфель, в который входят все ценные бумаги, обращающиеся на рынке, – это ... портфель
- 14 В контексте модели CAPM ... ценная бумага – это государственная бескупонная облигация со сроком погашения, равным холдинговому периоду





- 15) Линия рынка капитала применима для оценки ...
- 16) В соответствии с моделью CAPM безрисковая ставка ...
- 17) Левая граница области существования портфелей, все портфели на которой либо обеспечивают максимальную ожидаемую доходность при каждом выбранном уровне риска, либо обеспечивают минимальный риск для каждой выбранной средней ожидаемой доходности, называется граница ... портфелей
- 18) Определите верную последовательность управления инвестиционными рисками:
- 19) Доходность акции за первый год составляет 20%, за второй равна 25%, за третий равна 18%, за четвертый 21%, а за пятый 19%. В таком случае риск (стандартное отклонение) актива составит ... %
- 20) Если инвестор осуществляет активный поиск инвестиционных идей, то в общем случае такое его поведение можно отнести к ...
- 21) Инвестиционная стратегия должна учитывать ...
- 22) Совокупность практических средств и методов достижения инвестиционных целей фирмы в краткосрочном периоде с учетом текущих возможностей привлечения инвестиционных ресурсов – это инвестиционная ...
- 23) При разработке инвестиционной стратегии предприятие рассматривается как открытая система, что означает, что ...
- 24) Перевод низколиквидных активов в более ликвидную форму активов – это ...
- 25) Силье управления, когда инвестор осуществляет активный поиск инвестиционных идей, является ...
- 26) Инвестиционная стратегия представляет собой...
- 27) Процесс разработки инвестиционной стратегии предприятия начинается с ...
- 28) Утверждение о том, что инвестиционная стратегия обязательно должна носить целевой характер ...
- 29) Инвестиционная стратегия должна учитывать ...
- 30) Определите верную последовательность выполнения этапов разработки и реализации инвестиционной стратегии:





- 31) Стратегия «пылесоса» предполагает, что...
- 32) Стратегия «гибкого реагирования» предполагает, что...
- 33) Стратегия «рыночного опережения» предполагает, что...
- 34) Инвестиционная стратегия, предполагающая снижение инвестиционного риска посредством совершения сделок с производными финансовыми инструментами – это ...
- 35) Финансовая операция, заключающаяся в трансформации низколиквидных активов в относительно ликвидные ценные бумаги, обеспеченные денежными поступлениями от исходных активов, в результате которой происходит перераспределение риска между участниками сделки – это ...
- 36) Инвестор составляет портфель в соответствии со стратегией иммунизации портфеля облигаций и включает облигации А и Б, дюрации которых соответственно равны 3,5 года и 5,2 года. Инвестиционный период составляет 4 года. Определите веса облигаций в инвестиционном портфеле.
- 37) Компания придерживается стратегии иммунизации. Определите, чему будет равна дюрация портфеля облигаций в размере 2 млрд. руб., если дюрация активов составляет 4,3 года, а их величина равна 2,3 млрд. руб.
- 38) В мере Шарпа учитывается...
- 39) Случай, когда при сравнении оцениваемого портфеля с рыночным портфелем использование меры Трейнора покажет, что оцениваемый портфель хуже рыночного, а мера Шарпа – лучше рыночного, ...
- 40) Если определять доходность IRR, исходя из того, что чистая приведенная стоимость NPV равна нулю, то первоначальная вложенная инвестором сумма ...
- 41) Дневную взвешенную по времени доходность ...
- 42) Способ управления инвестиционным портфелем, предполагающий постоянную продажу финансовых средств, цена которых снижается, и покупку финансовых средств, растущих в цене, – это ...





- 43) Пассивный способ управления инвестиционным портфелем, предполагающий подбор в диверсифицированный портфель ценных бумаг, имеющих лучшее, чем среднерыночное, соотношение «риск / доходность» финансовых инструментов – это ...
- 44) Формула отражает меру...
- 45) Формула отражает меру ...
- 46) Представленная формула отражает меру ...
- 47) Расставьте в правильной последовательности этапы нахождения меры Трейнора:
- 48) В исходный момент времени $t=0$ инвестор вложил средства в акции компании, по которым не выплачивается дивиденд. Через год цена акции понизилась вдвое, и менеджер решает продать 50% портфеля. В конце второго года цена акции возвращается к исходному уровню. Внутренняя норма доходности, полученная менеджером за два года, в этом случае составит ...
- 49) И мера Трейнора, и мера Дженсена для оценки риска портфеля используют коэффициент i . Укажите, является ли указанный коэффициент одинаковым в двух моделях.
- 50) Установите соответствие между определениями и наименованиями показателей:
- 51) Если при графическом отображении меры Дженсена линии, соответствующие возможным портфелям, проходят параллельно друг другу, то случай, когда для оцениваемых портфелей эти линии пересекутся, теоретически ...
- 52) Применять линии возможных портфелей PPL для исследования портфелей в тех случаях, когда коэффициенты i оцениваемых портфелей отрицательны, ...
- 53) Если потоки денег поступают нерегулярно, то целесообразно вычислять денежно взвешенную доходность ...
- 54) Ставка дисконта, при которой приведенная стоимость потоков денег за определенный период времени равняется начальной инвестиционной сумме – это внутренняя ... доходности
- 55) В мере Трейнора учитывается...
- 56) В мере Дженсена учитывается...





- 57) Методы технического анализа использовать на рынке облигаций ...
- 58) Если инвестор применяет фундаментальный анализ, то цена ценной бумаги будет им определяться на основе анализа ...
- 59) Установите соответствие между формулами и их характеристиками:
- 60) Технический анализ по сравнению с фундаментальным анализом ...
- 61) К методам, основанным на анализе графиков движения цен акций, относят ...
- 62) Доходность акции за первый год составляет 20%, за второй равна 25%, за третий равна 18%, за четвертый 21%, а за пятый 19%. Средняя ожидаемая доходность актива составит ...
- 63) У компании А показатель P/E равен 15, у компании В составляет 25, у компании С – 27. При прочих равных условиях инвестору стоит приобрести ценную бумагу компании ...
- 64) Ситуация, когда рыночная стоимость акции окажется ниже ее экономической стоимости встретиться ...
- 65) Определите верную последовательность аксиом технического анализа, так чтобы получилась «спираль»:
- 66) В процессе проведения фундаментального анализа проводится трехуровневый анализ: макроэкономический анализ, анализ мезоуровня и анализ ...
- 67) Показатель P/E отражает ...
- 68) Показатель EPS отражает ...
- 69) Показатель P/S отражает ...
- 70) Истинная линия тренда предполагает, что она проходит как минимум через ... пика или впадины.
- 71) Инструмент технического анализа, который численно характеризует силу наблюдаемой тенденции или свидетельствует об ее отсутствии – это ...
- 72) Установите соответствие между аббревиатурами и их характеристиками:
- 73) В процессе проведения фундаментального анализа может быть использована ...





- 74) Если цена открытия ... цены закрытия, то тело свечи будет белое.
- 75) Если цена открытия больше цены закрытия, то тело свечи становится ...
- 76) Ситуация, когда рыночная стоимость акции окажется выше ее экономической стоимости встретиться ...
- 77) Применение метода технического анализа на рынке акций ...
- 78) Фундаментальный анализ не предполагает анализа ...
- 79) Фундаментальный анализ по сравнению с техническим анализом ...
- 80) Не относят к методам, основанным на анализе графиков движения цен акций, ...
- 81) Установите соответствие между видами инвестиционных стратегий и их характеристиками:
- 82) Установите соответствие между формулами и их характеристиками:
- 83) Установите соответствие между индексом и рынком, на котором он определяется:
- 84) Определите верную последовательность аксиом технического анализа, так чтобы получилась «спираль»:
- 85) Представьте обратную последовательность управления инвестиционными рисками:
- 86) Определите верную последовательность выполнения этапов разработки и реализации инвестиционной политики:
- 87) Расставьте в правильной последовательности этапы нахождения меры Шарпа:
- 88) Расставьте в правильной последовательности этапы нахождения меры Дженсена:
- 89) Доходность акции за первый год составляет 7%, за второй равна 10%, за третий равна 9%, за четвертый 11%, а за пятый 8%. Средняя ожидаемая доходность актива составит ... %
- 90) Инвестору предлагаю выбрать по показателю P/E ценную бумагу. Показатель P/E для ценной бумаги А равен 5, а для ценной бумаги С составляет 8. Инвестор при прочих равных условиях должен предпочесть ценную бумагу ...





- 91) Доходность акции за первый год составляет 7%, за второй равна 10%, за третий равна 9%, за четвертый 11%, а за пятый 8%. Риск актива составит ... %
- 92) Портфель состоит из двух акций А и В, ожидаемая доходность которых равна 15% и 10% соответственно. Всего у инвестора имеет 1 млн. руб., который он полностью тратит на приобретение акций А и В. 300 тыс. руб. инвестор тратит на покупку акции А. Ожидаемая доходность портфеля составит ... %.
- 93) Ситуация, когда рыночная стоимость акции окажется выше ее экономической стоимости ...
- 94) Показатель, отражающий прибыль на акцию – это ...
- 95) Линия тренда может считаться истинной линией тренда, если она проходит как минимум через ...
- 96) Инструмент технического анализа, который численно характеризует силу наблюдаемой тенденции или свидетельствует об ее отсутствии – это ...
- 97) При оценке акции посредством фундаментального анализа не может быть использована модель ...
- 98) Если тело свечи белое, то ...
- 99) Если тело свечи черное, то ...
- 100) Если рыночная стоимость акции ниже ее экономической стоимости, то акция может ...
- 101) Линия скользящих средних ...
- 102) К методам технического анализа относятся ...
- 103) В соответствии с правилом момента, если линия момента пересекает нулевую линию сверху вниз, то рекомендуется ... акцию.
- 104) К методам, основанным на расчете осцилляторов, относят ...
- 105) Фундаментальный анализ ... изучение и оценку макроэкономической ситуации в стране.
- 106) Ситуация, когда балансовая стоимость акции будет превышать ее экономическую стоимость ...





- 107) При проведении фундаментального анализа цена акции может быть оценена с использованием метода ... стоимости.
- 108) В соответствии с принципами технического анализа цена ценной бумаги определяется ...
- 109) Главная цель технического анализа – это ...
- 110) Одним из принципов технического анализа является то, что ...
- 111) Общеизвестной аббревиатурой индикатора схождения-расхождения скользящих средних является ...
- 112) Общеизвестной аббревиатурой индекса относительной силы является ...
- 113) Общеизвестной аббревиатурой индикатора скорости изменения цены является ...
- 114) Информацию о финансово-хозяйственной деятельности публичного акционерного общества для проведения фундаментального анализа инвестор может найти ...
- 115) Выделяют ... управление инвестиционным портфелем.
- 116) Пассивное управление портфелем ценных бумаг представляет собой ...
- 117) Если инвестор сформировал «портфель дохода» из облигаций федерального займа, то он намерен получать доход за счёт ... дохода.
- 118) Если инвестор сформировал портфель из государственных облигаций с целью получения стабильного дохода, то по склонности к риску такого инвестора можно отнести к ... типу
- 119) Безрисковым средством в модели CAPM обычно выступает...
- 120) Принимая решение о формировании композиционных портфелей с использованием безрискового суживания и заимствования, инвестор ... инвестиционное и финансовое решение.
- 121) В случае, если инвестор решил сформировать инвестиционный портфель из акций с использованием заемных средств, то это будет ... решение занять деньги
- 122) Параметр, который показывает, какая часть доходности какой-либо акции не зависит от изменения рыночного портфеля – это коэффициент ...





- 123 Не является принципом формирования инвестиционного портфеля ...
- 124 Совокупность нескольких инвестиционных объектов, которая управляется как единый инвестиционный объект ради получения прибыли или достижения иного положительного эффекта – это инвестиционный ...
- 125 У. Шарп в своей теории ... эффективных портфелей.
- 126 Доходность и риск инвестиционного портфеля ...
- 127 Если инвестиционный портфель входит 7 акций, то для его оптимизации в соответствии с методикой У. Шарпа необходимо определить ...
- 128 Портфельная бета ...
- 129 Коэффициент бета рыночного портфеля ...
- 130 Инвестиционная стратегия «хеджирование риска» предполагает ...
- 131 Линия рынка ценных бумаг применима для оценки ...
- 132 Портфель, в который входят все ценные бумаги, обращающиеся на рынке, – это ... портфель
- 133 В модели У. Шарпа фактическое значение доходности i -акции за t шаг расчета ...
- 134 Сумма весов акций в инвестиционном портфеле в теории Шарпа должна быть...
- 135 В модели Г. Марковица предполагается, что ...
- 136 Ковариация доходностей двух акций портфеля ...
- 137 Эффективному рынку ценных бумаг в контексте модели Г. Марковица присуще то, что ...
- 138 Инвестор сформировал портфель из акций А, В, С и вычислил их ожидаемые доходности: $E(r_a) = 0,1$; $E(r_b) = 0,07$; $E(r_c) = 0,06$ и задал веса $W_a = 0,3$; $W_b = 0,15$. Ожидаемая доходность такого портфеля равна ...





- 139) Пассивный способ управления инвестиционным портфелем, предполагающий подбор в диверсифицированный портфель ценных бумаг, имеющих лучшее, чем среднерыночное соотношение «риск / доходность» финансовых инструментов – это ...
- 140) Суммарный риск инвестиционного портфеля учитывается в мере ...
- 141) Способ управления инвестиционным портфелем, ориентированный на достижение больших прибылей, чем при обычной практике взвешенного риска – это ... управление.
- 142) Стилль управления, когда инвестор осуществляет управление инвестиционным портфелем, не имея четкой ..., является бессистемным управлением.
- 143) Перевод низколиквидных активов в более ликвидную форму активов – это ...
- 144) Показатель, отражающий превышение доходности портфеля над безрисковой доходностью в каждый момент рассматриваемого периода (за каждый шаг расчета) – это мера ...
- 145) Стратегия «рыночного опережения» не предполагает, что...
- 146) Только систематический риск учитывается в мере ...
- 147) Инвестиционная стратегия не должна учитывать...
- 148) Вычислять денежно взвешенную доходность за день целесообразно, если денежные потоки носят ... характер
- 149) Система долгосрочных целей инвестиционной деятельности предприятия, определяемых общими задачами его развития и инвестиционной идеологией – это ... стратегия
- 150) Инвестиционная стратегия не должна учитывать ...
- 151) Показатель, отражающий дополнительную отдачу инвестиционного портфеля на единицу систематического риска, выраженного коэффициентом β – это мера...
- 152) Показатель, отражающий соотношение превышения средних величин доходности инвестиционного портфеля над средней безрисковой доходностью к суммарному риску портфеля, выраженному стандартным отклонением – это мера ...
- 153) Стратегия «пылесоса» не предполагает, что...





- 154) Годовую взвешенную по времени доходность ...
- 155) Стратегия «гибкого реагирования» не предполагает, что...
- 156) Если инвестор формирует хорошо диверсифицированный инвестиционный портфель из акций инновационных компаний и не трансформирует его длительный период времени, то в общем случае такое его поведение можно отнести к ... стилю управления
- 157) В теории величина P / E ...
- 158) Величину P/E можно вычислить как ...
- 159) SWOT-анализ подразумевает, что происходит исследование сильных и ... сторон компании
- 160) При проведении фундаментального анализа аналитик стремится определить ... стоимость.
- 161) Утверждение «оптимальный портфель обязательно должен быть эффективным» ...
- 162) В мере Шарпа учитывается систематический и ... риск
- 163) Утверждение о том, что инвестиционная стратегия обязательно должна носить целевой характер ...
- 164) Если риск портфеля определяется возможным изменением налоговых ставок, то такой риск можно считать ... риском.
- 165) Принцип формирования портфеля, заключающийся в распределении средств по различным видам активов в целях снижения рисков, – это принцип ...
- 166) Если ожидаются резкие колебания процентной ставки, более рисковым ...

