1. Факторные бета-коэффициенты и ожидаемые доходности рискованных активов приведены ниже.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Акция |  |  |
| 1  2  3 | 2,2  1,4  0,7 | 14  20  8 |

Найдите арбитражный портфель, определите его ожидаемую доходность.

2. Факторные бета-коэффициенты и ожидаемые доходности рискованных активов приведены ниже.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Акция |  |  |  |
| 1  2  3  4 | 1,2  2,2  1,7  2,0 | 2,4  1,4  1,6  1,2 | 10  12  12  14 |

Найдите арбитражный портфель, определите его ожидаемую доходность.

3. Ожидаемая доходность рыночного портфеля , а стандартное отклонение его доходности . Определить бета-коэффициент рискованного актива, если ковариация между доходностью этого актива и доходностью рыночного портфеля равна а) 0,15 б) 0,2 в) -0,1. В каждом случае определить равновесную ожидаемую доходность рискованного актива, если безрисковая процентная ставка составляет 7%.