## СОДЕРЖАНИЕ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

Вариант 1.

1. Стоимость портфеля инвестора составляла 500 млн. руб. Волатильность за квартал 5,1%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,1%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,41%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 90%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.
2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,1%, ожидаемая доходность за месяц 1,1%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 95% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,51%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 2.

1. Волатильность за квартал 5,2%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,2%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,42%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 95%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,2%, ожидаемая доходность за месяц 1,2%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 90% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,52%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 3.

1. Волатильность за квартал 5,3%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,3%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,43%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 97,5%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,3%, ожидаемая доходность за месяц 1,3%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 95% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,53%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 4.

1. Волатильность за квартал 5,4%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,4%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,44%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 99%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,4%, ожидаемая доходность за месяц 1,4%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 97,5% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,54%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 5.

1. Волатильность за квартал 5,5%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,5%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,45%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 90%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,5%, ожидаемая доходность за месяц 1,5%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 99% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,55%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 6.

1. Волатильность за квартал 5,6%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,6%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,46%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 95%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,6%, ожидаемая доходность за месяц 1,6%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 90% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,56%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 7.

1. Волатильность за квартал 5,7%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,7%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,47%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 97,5%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,7%, ожидаемая доходность за месяц 1,7%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 95% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,57%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 8.

1. Волатильность за квартал 5,8%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,8%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,48%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 99%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,8%, ожидаемая доходность за месяц 1,8%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 97,5% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,58%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 9.

1. Волатильность за квартал 5,9%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,9%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,49%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 90%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,9%, ожидаемая доходность за месяц 1,9%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 99% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,59%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?

Вариант 10.

1. Волатильность за квартал 5,0%, ожидаемая доходность портфеля за квартал 4,0%. В портфель добавили безрисковый актив на сумму 250 млн. руб. Доходность безрискового актива за квартал 0,40%. Определить трехмесячные ожидаемые потери (VaR) нового портфеля с уровнем доверия 95%. Распределение стоимости портфеля считать нормальным.

2. Стоимость портфеля инвестора составляет 5 млн. руб. Волатильность за месяц 2,0%, ожидаемая доходность за месяц 1,0%. Определить одномесячные ожидаемые потери (VaR) портфеля (в млн. руб.) с уровнем доверия 90% Допустим, доходность безрискового актива за месяц составляет 0,50%. Какую часть единичного капитала инвестору необходимо вывести в безрисковый актив, чтобы показатель ** по портфелюснизился вдвое?