

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/gotovye-raboty/kontrolnaya-rabota/201995>

Тип работы: Контрольная работа

Предмет: Финансовые риски

-

Удельный вес актива X в портфеле – 30 %, актива Y – 70%, стандартное отклонение доходности актива X – 16 %, а актива Y – 20 %, ковариация доходностей активов -200 % (минус двести). Определите риск портфеля, измеренный стандартным отклонением.

Решение.

Для оценки риска портфеля, определим дисперсию доходности портфеля по формуле:

где WA – удельный вес актива X в портфеле;

WB – удельный вес актива Y в портфеле;

σ_X – стандартное отклонение доходности актива X;

σ_Y – стандартное отклонение доходности актива Y;

corXY – коэффициент корреляции доходностей активов X и Y.

Показатель корреляции определяется по формуле:

$$\text{CorXY} = \text{CovXY} / (\sigma_X * \sigma_Y),$$

где CovAB – ковариация доходности активов X и Y;

σ_A – стандартное отклонение доходности актива X;

σ_B – стандартное отклонение доходности актива Y.

$$\text{CorXY} = -200 / (16 * 20) = -0,625$$

Дисперсия доходности портфеля составит:

Стандартное отклонение доходности портфеля составит:

-

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/gotovye-raboty/kontrolnaya-rabota/201995>