1.Портфель состоит из 350 акций фирмы А, 500 акций фирмы Ви 1150 акций фирмы С. Текущие рыночные цены акций соответст­венно 20, 50 и 15 долл. Ожидаемая доходность акций фирмы А составляет 17%, фирмы В – 15%, фирмы С – 10% годовых. Определите ожидаемую средневзвешенную доходность портфеля.

2.Экспертами предоставлены данные об ожидаемой доходности акций *А* и *В* в зависимости от общеэкономической ситуации:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Экономическая ситуация | Вероятность | Доходность А, % | Доходность В, % |
| Быстрый рост экономики  (оптимистическая оценка) | 0,10 | 15 | 17 |
| Умеренный рост экономики (наиболее вероятная оценка) | 0,70 | 11 | 14 |
| Нулевой рост экономики  (пессимистическая оценка) | 0,20 | 8 | 9 |

1.Рассчитайте наиболее вероятную доходность каждого актива (kml), среднеквадратическое отклонение (σс), коэффициент вариации (CV).

2. Каковы ваши рекомендации инвестору по вложению средств?