

Kockázat feladatok - 03

Egy portfólió megoszlása, éves várható hozama és varianciája az alábbi:

	Megoszlás: (%)	Hozam (%)	Variancia (%)
Delta részvény	70	19	30
Gamma részvény	30	20	26

Mekkora a portfólió várható hozama és varianciája, ha a két részvény

a) korrelációja tökéletesen pozitív?

b) független egymástól?

a) Hozam: $r_p = 0,7 * 19\% + 0,3 * 20\% = 19,3\%$

$s = 0,7 * 30 + 0,3 * 26 = 28,8\%$

b) $s^2 = (0,7*30)^2 + 0 + (0,3*26)^2 = 441 + 60,84 = 501,84$

$s = 22,40\%$