5.

|  |  |
| --- | --- |
| Проект 1 | Проект 2 |
| Прибыль, млн. руб. | Вероятность | Вероятность, при которой ЛПР безразличен к выбору | Прибыль, млн. руб. | Вероятность | Вероятность, при которой ЛПР безразличен к выбору |
| 60 | 0,3 | - | -15 | 0,6 | - |
| 35 | 0,7 | 0,1 | 45 | 0,2 | 0,2 |
| - | - | - | 50 | 0,2 | 0,4 |

    Построить функцию полезности. Выбрать лучший проект инвестирования по показателю ожидаемая полезность.

    6. Доходность акций

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Акции А | Акции Б | В целом по рынку |
| 8 | 26 | 15 |
| 10 | 37 | 20 |
| 12 | 24 | -6 |
| 14 | -7 | 15 |
| 5 | 6 | 20 |
| 10 | 20 | 30 |

    Состав портфеля: акции А - 40 % , акции Б - 60 %.

    Оценить собственный и общий риск портфеля.

    7. Определить прибыль (убыток) продавца колл-опциона, если базисная цена опциона составляет 280 руб. премия 50 руб., а текущая цена базисного актива 300 руб.