

Etkin Sınır Nedir?

Çalışma Kağıdı

Etkin Sınır, aynı risk seviyesi için en yüksek getiriye sunan veya aynı getiri seviyesi için en düşük riski sunan varlık portföylerinin oluşturduğu eğridir.

Sorular

- Aşağıdakilerden hangisi etkin sınırı en iyi tanımlar?
 - En yüksek getiriye sunan tek bir portföy.
 - Belirli bir risk seviyesi için en yüksek getiriye sunan portföyler kümesi.
 - En düşük riski sunan portföyler kümesi.
 - Tüm olası portföylerin ortalaması.
- Etkin sınır eğrisi genellikle nasıl bir şekle sahiptir?
 - Düz bir çizgi
 - Sağa doğru eğimli bir yay
 - Sola doğru eğimli bir yay
 - Bir çember
- Bir portföy etkin sınırın altındaysa ne anlama gelir?
 - Portföy aşırı risklidir.
 - Portföy, mevcut risk seviyesi için suboptimal bir getiri sunmaktadır.
 - Portföy, piyasa ortalamasının üzerinde performans göstermektedir.
 - Portföy tamamen risksizdir.
- İki farklı varlıktan oluşan bir portföyün etkin sınırını nasıl çizeriz?
- Etkin sınır üzerindeki bir portföy neden tercih edilir?
- Tanımla: Etkin Sınır Kavramı
- Tanımla: Etkin Sınırın Amacı
- Tanımla: Etkin Sınırın Altındaki Portföyler

Cevap Anahtarı

1. B) Belirli bir risk seviyesi için en yüksek getiriye sunan portföyler kümesi. — Etkin sınır, her risk seviyesi için en iyi getiri potansiyelini temsil eden portföyleri gösterir.
2. C) Sola doğru eğimli bir yay — Varlıkların farklı risk ve getiri profilleri ile korelasyonları nedeniyle etkin sınır genellikle sol üst köşeye doğru eğimli bir yay şeklindedir.
3. B) Portföy, mevcut risk seviyesi için suboptimal bir getiri sunmaktadır. — Etkin sınırın altındaki portföyler, aynı risk seviyesinde daha yüksek getiri sunan başka portföylerin varlığı nedeniyle verimsizdir.
4. 1. Her varlığın beklenen getirisini ve riskini (standart sapma) hesaplayın. 2. Farklı ağırlıklarla oluşturulan portföylerin beklenen getirisini ve riskini hesaplayın. 3. Elde edilen portföy noktalarını, aynı risk için en yüksek getiriye verenleri seçerek birleştirerek etkin sınırı çizin.
5. Etkin sınır üzerindeki bir portföy, mevcut risk seviyesi için en iyi getiri potansiyelini sunduğu için tercih edilir. Sınırın altındaki portföyler, aynı riskle daha düşük getiri sunduğu için, sınırın üzerindeki portföyler ise aynı getiriyle daha yüksek risk taşıdığı için suboptimaldir.
6. Risk ve getiri arasında en verimli dengeyi sağlayan portföyleri gösteren eğri.
7. Yatırımcılara, belirli bir risk toleransı dahilinde en iyi getiri fırsatlarını sunmak.
8. Suboptimaldir; aynı riskle daha düşük getiri veya aynı getiriyle daha yüksek risk sunarlar.

Bounlu

Tüm kartlar, adım adım çözümler ve AI hoca desteği Notek uygulamasında.
Sınav tarihlerini Promy otomatik hatırlatıcıya çevirir.