1. Инвестор обладает акциями трех видов. Текущая рыночная стоимость каждого его актива равна 50 тыс.руб. Эти акции имеют следующие ожидаемые доходности и чувствительности:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Акция | Ожидаемая доходность | Чувствительность |
| 1 | 16 | 0,8 |
| 2 | 20 | 2,9 |
| 3 | 11 | 1,7 |

Составить арбитражный портфель.