

Ders # 6 için Quiz

Putnam şirketinde satış elemanı olarak çalışıyorsunuz. Müşteriniz, halihazırda aktif olarak yönetilen bir ürüne yatırım yapıyor. Müşteriniz, varlıklarını Vanguard şirketine taşımak istiyor ve Putnam'ın en büyük fonunda bulunan miktarın %70'ini, Vanguard'ın, S&P 500 endeksini yansıtan pasif fonuna aktarmayı düşünüyor.

Putnam'ın aktif fonunun beklenen getirisi %18 ve standart sapması %28.

Vanguard'ın S&P 500 endeksini yansıtan pasif fonunun beklenen getirisi %13 ve standart sapması %25.

$r_f = \%8$ ise

- Müşterinize yatırımlarını diğer şirkete aktarmasının avantajlı olmayacağını açıklayın.
- Müşterinize, sizin fonunuzda kalarak da diğer fonla en az aynı getiriye elde edebilmesini sağlayan maksimum ücretin ne olduğunu gösterin.