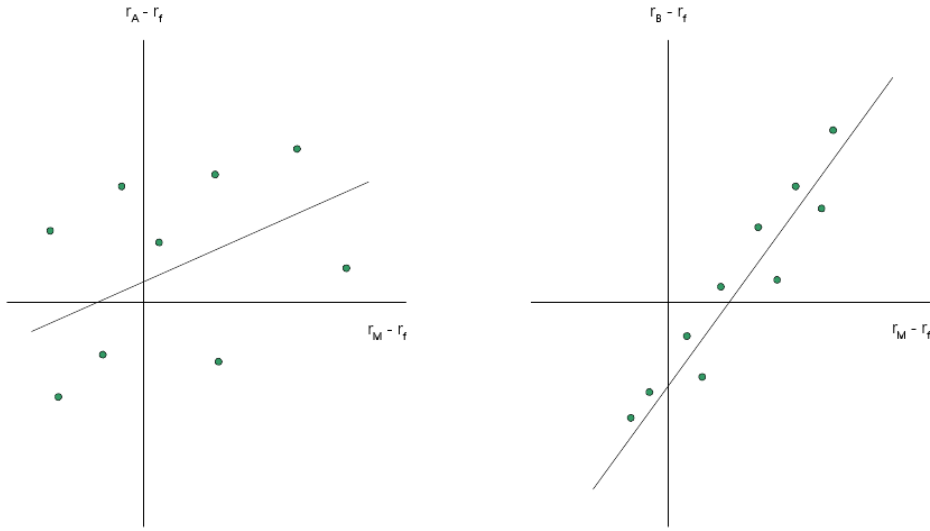


Ders # 9 için Quiz

Tek Endeksli ve Çok Faktörlü Modeller

A ve B hisse senetleri için aşağıdaki regresyon çizgilerini ele alalım:



Şekil 1: A ve B hisse senetlerinin piyasa ile regresyonu

Hangi hisse senedinin firmaya özel riski daha fazladır?

Hangi hisse senedinin sistematik (piyasa) riski daha çoktur?

Hangi hisse senedinin R^2 ' si daha yüksektir?

Hangi hisse senedinin alfası daha yüksektir?

Hangi hisse senedinin piyasa ile korelayonu daha fazladır?

Soru: Analitik bir çözüme başvurmadan soruları tartışın.