

واحد منزلي في مقياس إدارة المحفظة الماليةالتمرين رقم 01:

محفظة أوراق مالية تتكون من ثلاثة أسهم: السهم (A) والسهم (B) والسهم (C) بنسبة 50%، 30%، 20% على التوالي، وبعائد محقق على الترتيب 18%， 15%， 20%， وبدرجة مخاطرة محسوبة وفق الانحراف المعياري 0.07، 0.09، 0.11 على التوالي، مع عدم وجود ارتباط بين الأسهم الثلاثة.

المطلوب

- 1- حساب عائد المحفظة.
- 2- حساب مخاطر المحفظة.

التمرين رقم 02:

تملك شركة من شركات الاستثمار محفظة أوراق مالية مشكلة كما يلي:

المعامل (β)	القيمة السوقية	الأوراق المالية
3	50 000	أسهم عادية
4	30 000	أسهم ممتازة
0.5	40 000	سندات حكومية
0.6	20 000	سندات شركات خاصة
0.2	60 000	أذن الخزينة

المطلوب: حساب مخاطر المحفظة وفق مقياس بيتا.

التمرين رقم 03 : يوضح الجدول التالي العائد لأربعة محافظ أوراق مالية، ومعدل العائد الخالي من الخطر خلال 4 سنوات.

المحافظة	العائد على استثمار المحفظة %	العائد على استثمار خالي من الخطر %	الانحراف المعياري للمحفظة %
A	12	6	8
B	9	6	10
C	10	6	15
D	8	6	14

المطلوب: ترتيب المحافظ الأربعة حسب أدائهم وفقاً لمقاييس شارب.