

واجب منزلي في مقياس إدارة المحفظة الماليةالتمرين رقم 01:

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

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

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.

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

**المطلوب:** ترتيب المحافظ الأربعة حسب أدائهم وفقا لمقياس شارب.