

العلامة	رقم التسجيل	الفوج	الاسم واللقب
------------------	----------------------	----------------	-----------------------

التصحيح النموذجي لإمتحان الدورة العادية للسداسي الثاني في مادة إدارة المحفظة المالية

تمرين:

D	C	B	A		
0.0900	0.1500	0.2500	0.1800	$\delta\epsilon$	
0.4000	1.3000	0.5000	1.1000	β_i	
0.0900	0.2200	0.0300	0.2000	α_i	
0.2500	0.3500	0.3000	0.1000	W_i	
0.1000				$E(R_m)$	
0.0500				δ_m	
0.1300	0.3500	0.0800	0.3100	$E(R_i) = \alpha_i + \beta_i E(R_m)$ ن 05	
0.0085	0.0267	0.0631	0.0354	$\delta_i^2 = \beta_i^2 \delta_m^2 + \delta\epsilon^2$ ن 05	
0.2100				$E(R_p) = \alpha_p + \beta_p \cdot E(R_m)$ ن 03	
D	C	B	A		$COV_{ij} = \beta_i \cdot \beta_j \cdot \delta_m^2$ ن 06
0.0011	0.0036	0.0014	0.0354	A	
0.0005	0.0016	0.0631	0.0014	B	
0.0013	0.0267	0.0016	0.0036	C	
0.0085	0.0013	0.0005	0.0011	D	
0.0109				$\delta_p^2 = \sum w_i^2 \cdot \delta_i^2 + 2 \sum w_i \cdot w_j \cdot cov_{ij}$ ن 01	

التصحيح النموذجي لإمتحان الدورة العادية للسداسي الثاني في مادة إدارة المحفظة المالية

تمرين:

D	C	B	A		
0.0900	0.0300	0.4000	0.1600	$\delta \epsilon$	
0.5000	1.3000	1.1000	1.2000	β_i	
0.0900	0.2200	0.2000	0.2000	α_i	
0.4000	0.2000	0.2500	0.1500	W_i	
0.1000				$E(R_m)$	
0.0500				δ_m	
0.1400	0.3500	0.3100	0.3200	$E(R_i) = \alpha_i + \beta_i E(R_m)$ ن 05	
0.0087	0.0051	0.1630	0.0292	$\delta_i^2 = \beta_i^2 \delta_m^2 + \delta \epsilon^2$ ن 05	
0.2515				$E(R_p) = \alpha_p + \beta_p \cdot E(R_m)$ ن 03	
D	C	B	A		$COV_{ij} = \beta_i \beta_j \cdot \delta_m^2$ ن 06
0.0015	0.0039	0.0033	0.0292	A	
0.0014	0.0036	0.1630	0.0033	B	
0.0016	0.0051	0.0036	0.0039	C	
0.0087	0.0016	0.0014	0.0015	D	
0.0140				$\delta_p^2 = \sum w_i^2 \cdot \delta_i^2 + 2 \sum w_i \cdot w_j \cdot cov_{ij}$ ن 01	

التصحيح النموذجي لإمتحان الدورة العادية للسداسي الثاني في مادة إدارة المحفظة المالية

تمرين:

الجمهورية الجزائرية الديمقراطية الشعبية
وزارة التعليم العالي والبحث العلمي
المركز الجامعي عبد الحفيظ بوالصوف ميللة

كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير

قسم العلوم الاقتصادية

السنة أولى ماستر اقتصاد نقدي ومالي

السنة الجامعية: 2024/2023

زمن الامتحان: 1.30 سا

D	C	B	A		
0.0900	0.2500	0.4000	0.1600	$\delta\epsilon$	
0.4000	1.3000	1.1000	1.2000	β_i	
0.0900	0.2200	0.0300	0.2000	α_i	
0.2000	0.3500	0.2500	0.2000	W_i	
0.1000				$E(R_m)$	
0.0500				δ_m	
0.1300	0.3500	0.1400	0.3200	$E(R_i) = \alpha_i + \beta_i E(R_m)$ ن 05	
0.0085	0.0667	0.1630	0.0292	$\delta_i^2 = \beta_i^2 \delta_m^2 + \delta\epsilon^2$ ن 05	
0.2475				$E(R_p) = \alpha_p + \beta_p \cdot E(R_m)$ ن 03	
D	C	B	A		$COV_{ij} = \beta_i \cdot \beta_j \cdot \delta_m^2$ ن 06
0.0012	0.0039	0.0033	0.0292	A	
0.0011	0.0036	0.1630	0.0033	B	
0.0013	0.0667	0.0036	0.0039	C	
0.0085	0.0013	0.0011	0.0012	D	
0.0218				$\delta_p^2 = \sum w_i^2 \cdot \delta_i^2 + 2 \sum w_i \cdot w_j \cdot cov_{ij}$ ن 01	

التصحيح النموذجي لامتحان الدورة العادية للسداسي الثاني في مادة إدارة المحفظة المالية

تمرين:

D	C	B	A		
0.0900	0.2000	0.4000	0.1200	$\delta\epsilon$	

1.1100	1.3000	0.1000	0.1500	β_i	
0.0900	0.2200	0.2000	0.2000	α_i	
0.3000	0.3000	0.2000	0.2000	W_i	
0.1000				$E(R_m)$	
0.0500				δ_m	
0.2010	0.3500	0.2100	0.2150	$E(R_i) = \alpha_i + \beta_i E(R_m)$ ن 05	
0.0112	0.0442	0.1600	0.0145	$\delta_i^2 = \beta_i^2 \delta_m^2 + \delta \epsilon^2$ ن 05	
0.2503				$E(R_p) = \alpha_p + \beta_p \cdot E(R_m)$ ن 03	
D	C	B	A		$COV_{ij} = \beta_i \cdot \beta_j \cdot \delta_m^2$ ن 06
0.0004	0.0005	0.0000	0.0145	A	
0.0003	0.0003	0.1600	0.0000	B	
0.0036	0.0442	0.0003	0.0005	C	
0.0112	0.0036	0.0003	0.0004	D	
0.0128				$\delta_p^2 = \sum w_i^2 \cdot \delta_i^2 + 2 \sum w_i \cdot w_j \cdot cov_{ij}$ ن 01	