

التمرين الأول:

- إذا افترضنا أن قيمة معامل بيتا لسهم شركة النور 2 ماذا يعني هذا؟ ماهي عدد القيم الممكنة ل معامل بيتا؟
- ماهي قيم الممكنة لمعامل الارتباط r ؟

التمرين 2: إذا أتاحت لك البيانات التالية المتعلقة بالسهمين: A وسهم السوق m

الفترة	R_A	R_M
1	50	50
2	60	60
3	40	40
4	70	40
5	30	20

المطلوب : أحسب معامل بيتا ؟ فسر النتيجة؟

التمرين 3: لديك المعلومات التالية حسب حالات الطبيعة والاحتمالات المبينة إزاء كل حالة عن السهم A وسهم السوق M في الجدول الموالي:

الأصل	P_i	R_A	R_M
ازدهار	0,2	0.3	0.25
عادية	0.6	0,2	0.15
انحسار	0.2	0.05-	0.07-

المطلوب: أحسب معامل بيتا ؟ فسر النتيجة؟

التمرين 4:

أحسب معامل بيتا لسهم شركة العافية إذا علمت أن الانحراف المعياري لسهم السوق هو 0.03 وكان معامل الارتباط بين هذا السهم وسهم السوق يأخذ الحالات التالية :

معامل الارتباط يساوي على التوالي 0، 1، -1، 0.5، -2.