

التمرين الأول: تتكون محفظة من:

300 سهم للشركة س بقيمة 10 دولار للسهم الواحد وتتوقع عائد قدره 8 %

50 سهم من الشركة ع بقيمة 40 دولار للسهم الواحد وتتوقع عائد قدره 13 %

- أحسب القيمة الاجمالية للمحفظة؟ وماهي أوزانها ؟ وماهو عائدها؟

لنفترض أن سعر سهم الشركة س ارتفع إلى 12 دولار وانخفض سعر الهم ع إلى 36 دولار.

-أحسب قيمة المحفظة الجديدة ؟ وماهو عائدها؟ وماهي أوزانها؟

التمرين 2:

إذا أتيحت لك البيانات التالية المتعلقة بمحفظة مالية مكونة من سهمين : 30% السهم A و 70% السهم B.

الفترة	R_A	R_B	R_C
1	50	50	40
2	60	60	50
3	40	40	60
4	70	40	55
5	30	20	85

المطلوب: حساب العائد المتوقع للمحفظة والانحراف المعياري للمحفظة إذا علمت أن التباين المشترك بين الاصلين يساوي 0,9؟

بعد مدة من الاستثمار قرر المستثمر إضافة سهم جديد الى تشكيلة المحفظة بحيث تصبح الأوزان النسبية لهذه الأصول 30% ، 40% ، 30% على التوالي . في حين كانت قيم معامل الارتباط بين الأصول تأخذ القيم التالية : $r(A.B)=1$ ، $r(A.C)=-1$ ، $r(B.C)=0.5$

- أحسب عائد وخطر المحفظة الجديدة؟

التمرين 3

لنفترض أن مستثمر قام ببناء محفظة اعتمادا على أصلين خطرين فقط، حيث خصص 45% من المبلغ الاجمالي للاستثمار في الأصل الأول والباقي للاستثمار في الاصل الثاني، فإذا كان الانحراف المعياري للأصل الأول 0.05، والانحراف المعياري للأصل الثاني 0.09 .

المطلوب : حساب مخاطر المحفظة إذا كان معامل الارتباط يأخذ القيم التالية: 1، 0.5، 0، -1، -0.5 .