

## واجب:

فيما يلي الحالات الاقتصادية واحتمال حدوثها وعائد كل من الاستثمار a والاستثمار b

| عائد الاستثمار b | عائد الاستثمار a | الاحتمال | الظروف المحتملة |
|------------------|------------------|----------|-----------------|
| 20%              | 10%              | 0.60     | رواج            |
| 5- %             | 5- %             | 0.40     | كساد            |

المطلوب:

عائد الاستثمار a:

| P* r       | ri   | p    | الظروف | (r - r̄)² | p*(r - r̄)² |
|------------|------|------|--------|-----------|-------------|
|            | 10%  | 0.60 | 1      |           |             |
|            | 5- % | 0.40 | 2      |           |             |
| r̄ = ..... |      |      |        | σ = ..... |             |
| σ² = ..... |      |      |        | .....     |             |

1- العائد المتوقع للاستثمار a يساوي:

(أ) 4% (ب) 5% (ج) 8% (د) 7.5% (هـ) لا شيء مما سبق

2- الانحراف المعياري لعائد الاستثمار a يساوي:

(أ) 54 (ب) 7.35 (ج) 10.8- (د) 16.8 (هـ) لا شيء مما سبق

عائد الاستثمار b:

| P* r       | ri   | p    | الظروف | (r - r̄)² | p*(r - r̄)² |
|------------|------|------|--------|-----------|-------------|
|            | 20%  | 0.60 | 1      |           |             |
|            | 5- % | 0.40 | 2      |           |             |
| r̄ = ..... |      |      |        | σ = ..... |             |
| σ² = ..... |      |      |        | .....     |             |

3- العائد المتوقع للاستثمار b يساوي:

(أ) 14% (ب) 25% (ج) 15% (د) 10% (هـ) لا شيء مما سبق.

4- الانحراف المعياري لعائد الاستثمار b يساوي:

(أ) 150 (ب) 12.25 (ج) 7.75 (د) 9.49 (هـ) لا شيء مما سبق

5- بالاعتماد على ما سبق أي من الاستثمارين هو الأفضل ولماذا؟

6- حساب عائد ومخاطرة المحفظة إذا علمت أن عائد الاستثمار A يمثل 70% من المحفظة.