

**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:**

$p^*(r - \bar{r})^2$	$(r - \bar{r})^2$	$(r - \bar{r})$	$P^* r$	$r_i$	$p$	الظروف
				10%	0.60	1
				5- %	0.40	2
$\sigma^2 = \dots \dots \dots \sigma =$			$\bar{r} = \dots \dots \dots$			
.....						

1- العائد المتوقع للاستثمار a يساوى:

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

2- الانحراف المعياري لعائد الاستثمار a يساوى:

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

**عائد الاستثمار b:**

$p^*(r - \bar{r})^2$	$(r - \bar{r})^2$	$(r - \bar{r})$	$P^* r$	$r_i$	$p$	الظروف
				20%	0.60	1
				5- %	0.40	2
$\sigma^2 = \dots \dots \dots \sigma =$			$\bar{r} = \dots \dots \dots$			
.....						

3- العائد المتوقع للاستثمار b يساوى:

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

4- الانحراف المعياري لعائد الاستثمار b يساوى:

(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.