

## السلسلة رقم 1 : حول محور عائد ومخاطر محفظة مالية

### التمرين رقم 1 :

الجدول التالي يتضمن البيانات المالية لعوائد السهمين A و B

السنة	عائد السهم A	عائد السهم B
1	12	5
2	4-	15-
3	0	10
4	20	38
5	2	17

المطلوب : حساب العائد لكل سهم

### التمرين رقم 2 :

افترض أحد المستثمرين يرغب بشراء سهم معين و ان احتمال تحقق العوائد و تقديرات المستثمر للحصول عليها كانت كمايلي :

العائد	الاحتمال
2	10
10	44
14	40
20	6

### التمرين رقم 3:

فيمايلي التوزيع الاحتمالي لعوائد الشركتين A.B وفقا للحالة الاقتصادية السائدة ، و المطلوب تحديد أي من الشركتين يكون فيها الاستثمار أكثر خطورة وذلك من خلال احتساب التباين ، الانحراف المعياري، معامل الاختلاف

الحالة الاقتصادية	احتمال حدوث العائد	عائد الشركة a	عائد الشركة b
ركود	0.80	-20	30
انتعاش	0.20	70	10

