

أعمال موجهة رقم 2

التمرين رقم 1

ليكن لديك محفظة مالية رأسمالها 2000 وحدة نقدية مكونة من أصلين ما ليين أ وب وكانت المعلومات المتوفرة عن المحفظة ملخصة في الجدول الموالي:

- أحسب متوسط العائد للمحفظة المالية؟

الأصل	مبلغ الاستثمار	معدل العائد
A	800	40
B	1200	36

التمرين رقم 2

يعرض الجدول الآتي بيانات العائد المتوقع لثلاثة أسهم (1، 2 و3) حيث العائد عند كل نسبة حدث π_i بافتراض أن هناك أربع احتمالات تواجه هذه الأسهم. أحسب عائد المحفظة المتوقع ومخاطرتها؟

Ri%			
3	2	1	Pi%
4 -	13 -	18 -	20
2 -	16	16	25
21	32	12	30
20	12	40	25