

الاعمال الموجهة رقم 4

التمرين :

المعلومات الواردة في الجدول الموالي لمجموعة من الأوراق المالية المدرجة في سوق معينة للأوراق المالية، علما أن معدل العائد الخالي من المخاطرة 5% وأن تباين السوق 30%. وزع رأس المال على الأسهم الجيدة وحدد نصيب كل منها؟

الورقة	$R_i\%$	$B_i\%$	$V_i\%$
1	15	1	50
2	17	1.5	40
3	12	1	20
4	17	2	10
5	11	1	40

6	11	1.5	30
7	11	2	40
8	7	0.8	16
9	7	1	20
10	5.6	0.6	6

قرر المستثمر أحمد تشكيل محفظة من الأوراق المالية الجيدة التي تم اختيارها سابقا وقد خصص مبلغا قدره 420000 (وحدة نقدية)، فإذا توفرت له معلومات عن الوضع الاقتصادي خلال السنة القادمة وذلك نتيجة التحليل الفني والتحليل الأساسي لوضع سوق الأوراق المالية بأنه ستكون هناك حالة كساد، وتم تقدير هبوط معدل عائد السوق بحدود 20%. حدد مقدار هبوط معدل عائد المحفظة المذكورة أعلاه؟