

الحالات العملية:

الحالة الأولى: (مثال ملخص الأخت Business AL Faifi صفحة 26)

- ✓ تبلغ قيمة المحفظة الاستثمارية لأحد المستثمرين (5.000.000) ريال
- ✓ تتكون المحفظة الاستثمارية لهذا المستثمر من استثمارين (أ) و (ب)
- ✓ قيمة الاستثمار (أ) = 3.000.000 ريال
- ✓ قيمة الاستثمار (ب) = 2.000.000 ريال
- ✓ العائد من الاستثمار (أ) = 9 %
- ✓ العائد من الاستثمار (ب) = 12 %
- ✓

الحالة الثانية: (مثال ملخص الأخت Business AL Faifi صفحة 28)

- ✓ محفظة استثمارية تتكون من النشاط (أ) و (ب) بقيمة 100000 ريال.
- ✓ قيمة الاستثمار (أ) = 70000 ريال.
- ✓ قيمة الاستثمار (ب) = 30000 ريال.
- ✓ الحالات الاقتصادية و احتمال حدوثها و العائد المتوقع من كل مشروع كمايلي:

العائد المتوقع		احتمال الحدوث	الحالة الاقتصادية
المشروع ب	المشروع أ		
5%	10%	0.6	ركود
10%	15%	0.4	ازدهار

الحالة الثالثة: (مثال ملخص الأخت Business AL Faifi صفحة 32)

فيما يلي البيانات الخاصة بمشروعات استثمارية (أ - ب - ج) التي تتكون منها المحفظة الاستثمارية لإحدى المستثمرين:

العائد المتوقع			احتمال الحدوث	الحالة الاقتصادية
وزن المشروع (ج) = 0.4	وزن المشروع (ب) = 0.3	وزن المشروع (أ) = 0.3		
15%	10%	12%	25%	ازدهار
10%	8%	10%	50%	ظروف عادية
5%	4%	8%	25%	انكماش

الحالة الرابعة:

إذا توفرت لديك البيانات التالية عن محفظة استثمارية مكونة من مشروعين (a) و (b):

- ✓ الانحراف المعياري للمشروع a $(\sigma a) = 0.25$
- ✓ الانحراف المعياري للمشروع b $(\sigma b) = 0.32$
- ✓ الانحراف المشترك بين المشروعين a و b $(COVab) = 0.07$
- ✓ الانحراف المعياري للمشروع b $(ab) = 0.32$
- ✓ وزن المشروع س (wa) $= 60\%$
- ✓ وزن المشروع س (wb) $= 40\%$

الحالة الخامسة:

تقوم إحدى الشركات بإصدار أسهم ممتازة و بيعها بالسوق بقيمة اسمية 200 ريال للسهم. الأرباح الثابتة لهذا السهم 8% من القيمة الاسمية.