

شرح الواجب الاول العملي ادارة ماليه 2

السؤال 2 :-

2- اذا علمت بأن هناك محفظة استثمارية مكونة من مشروعين، حيث أن حصة الاستثمار في المشروع الأول هي 40000 ريال وحصة الاستثمار في المشروع الثاني هي 60000 ريال وعلمت بأن المشروع الأول يحقق عائد متوقع مقداره 8% ودرجة مخاطر بنسبة 3% والمشروع الثاني يحقق عائد متوقع مقداره 10% ودرجة مخاطر بنسبة 5% وعلمت بأن معامل الارتباط بين هاذين المشروعين هو 70%

فما هو العائد المتوقع من هذه المحفظة الاستثمارية؟

الإجابة :

أ- 8.5%

ب- 9.2%

ج- 10%

د- 13.6%

1 درجات

شرح الاجابه

دام طلب العائد المتوقع لازم نحسب نسبة كل مشروع المشروع الاول والمشروع الثاني

المشروع الاول : 40000

المشروع الثاني : 60000

راح نجمعهم $100000 = 60000 + 40000$

بعد ماجمعناهم الان نحسب نسب وزن كل مشروع

نسبة المشروع الاول = $40000 / 100000 = 40\%$

نسبة المشروع الثاني = $60000 / 100000 = 60\%$

الان نطبق قانون عائد المحفظة (نسبة المشروع الاول × العائد المتوقع للمشروع الاول) + (نسبة المشروع

الثاني × العائد المتوقع للمشروع الثاني)

العائد للمشروع الاول بالسؤال : 8%

العائد بالسؤال للمشروع الثاني : 10%

الان نطبق القانون بشكل عملي العوائد المتوقعه للمشروعين معطينا بنفس السؤال كتبته لكم :

$9.2\% = (0.1 \times 0.6) + (0.08 \times 0.4)$

إذن الإجابة تصبح 9.2%

السؤال 2 :-

إذا علمت بأن الانحراف المشترك بين عائدات السوق وعائد سهم شركة كيان هو 0.001686 و تباين عائدات السوق هو 0.0025

فإن معامل بيتا لسهم شركة كيان يساوي:

الإجابة :

أ- 0.006

ب- 0.0025

ج- 0.0015

د- 0.007

شرح الإجابة

هنا الدكتور غلط بالخيارات مفروض الإجابة غير اللي متواجده بالخيارات قانون بيتا يقول حساب الانحراف المشترك / حساب تباين السوق

$$0.6744 = \frac{0.001686}{0.0025}$$

وعندكم المحاضره الخامسه تقدرتون تتأكدون ونفس هالسؤال جابه ب اسئله الاختبار للترم الثاني سنه 1435 تقدرتون تتأكدون منه بعد ..

إن الإجابة تصبح 0.67

أمل باوزير – ورشة إدارة مالية 2