

الجزء الأول														
الحالة الاقتصادية	الاحتمال	عوائد أصول المحفظة			الانحراف			التباين			التباين المشترك			
		ندى	نادك	المراعي	ندى	نادك	المراعي	ندى	نادك	المراعي	ندى-نادك	ندى-المراعي	نادك-المراعي	
ازدهار	٥٠٪	٣٠٪	١٥٪	٢٠٪	٧,٠٠٪	١,٩٠-٪	٩,٠٠٪	٠,٢٤٥٪	٠,٠١٨٪	٠,٤٠٥٪	٠,٠٦٧-٪	٠,٣١٥٪	٠,٠٨٦-٪	
عادي	٣٠٪	٢٠٪	١٨٪	١٠٪	٣,٠٠-٪	١,١٠٪	١,٠٠-٪	٠,٠٢٧٪	٠,٠٠٤٪	٠,٠٠٣٪	٠,٠١٠-٪	٠,٠٠٩٪	٠,٠٠٣-٪	
ركود	٢٠٪	١٠٪	٢٠٪	١٠-٪	١٣,٠٠-٪	٣,١٠٪	٢١,٠٠-٪	٠,٣٣٨٪	٠,٠١٩٪	٠,٨٨٢٪	٠,٠٨١-٪	٠,٥٤٦٪	٠,١٣٠-٪	
	العائد المتوقع	٢٣,٠٠٪	١٦,٩٠٪	١١,٠٠٪			VAR	٠,٦١٪	٠,٠٤٪	١,٢٩٪	٠,١٦-٪	٠,٨٧٪	٠,٢٢-٪	COV
							STEDV	٧,٨١٪	٢,٠٢٪	١١,٣٦٪				
							CV	٠,٣٤	٠,١٢	١,٠٣				
										Correl	٠,٩٩-	٠,٩٨	٠,٩٥-	
الجزء الثاني														
الحالة الاقتصادية	الاحتمال	عوائد أصول المحفظة			تباين المحفظة	أند المحفظة في حالة								
		ندى	نادك	المراعي										
ازدهار	٥٠٪	٣٠٪	١٥٪	٢٠٪	١٠,٧٥٪	٠,١٦٪								
عادي	٣٠٪	٢٠٪	١٨٪	١٠٪	٤,٦٢٪	٠,٤١٪								
ركود	٢٠٪	١٠٪	٢٠٪	١٠-٪	١,٠٠٪	٠,٤٧٪								
	الأوزان النسبية	٣٠٪	٣٠٪	٤٠٪	١٦,٣٧٪	١,٠٤٪								
					عائد المحفظة	VAR(p)								
الجزء الثالث														
	Stdev(P)													
	ندى-نادك	٠,٠٢٩												
	ندى-المراعي	٠,٠٩٥												
	نادك-المراعي	٠,٠٤٧												