

2021/2020

جامعة الجيلالي بونعامة - خميس مليانة -

كلية العلوم الإقتصادية والتجارية وعلوم التسيير.

قسم العلوم الإقتصادية.

السنة الثانية ماستر: إقتصاد نقدي وبنكي (جميع الأفواج).

السلسلة رقم 05 : تقييم أداء المحافظ المالية.

01- لتكن لديك المعطيات التالية:

		المحفظة			
الأصل الخالي من المخاطرة	السوق	С	В	Α	البيان
8,6	11	13	14,5	17,1	معدل العائد المتوقع (%)
Ş	20,5	22,8	19,7	28,1	المخاطرة الكلية (%)
Ş	?	1,4	0,92	1,2	معامل بيتا

المطلوب: قيم أداء المحافظ الثلاثة وفق نسب شارب، ترينور وجنسن؟.

02- لتكن لديك المعطيات المبينة في الجدول التالي:

الأصل الخالي من المخاطرة	السوق	المحفظة B	المحفظة 🗛	السنة
4,7	24,2	25,4	26,3	2011
4,3	14,1	21,7	14,2	2012
4,5	6,5	9,2	17,5	2013
5,8	9,3	8,4	18,7	2014
6,2	11,5	18,5	23,6	2015
6,5	17,4	14,2	27,5	2016
7,8	3,7	5,4	7,9	2017
6,5	17,4	14,2	27,5	2018
7,8	3,7	5,4	7,9	2019

المطلوب: إذا علمت أن معامل بيتا للمحفظتين A و B يبلغ 1,3 و 0,9 على التوالي، قيم أداء المحفظتين وفق نسب شارب، ترينور وجنسن؟.