

01- لتكن لديك المعطيات التالية:

| البيان                  | المحفظة |      |      | السوق | الأصل الخالي من المخاطرة |
|-------------------------|---------|------|------|-------|--------------------------|
|                         | A       | B    | C    |       |                          |
| معدل العائد المتوقع (%) | 17,1    | 14,5 | 13   | 11    | 8,6                      |
| المخاطرة الكلية (%)     | 28,1    | 19,7 | 22,8 | 20,5  | ?                        |
| معامل بيتا              | 1,2     | 0,92 | 1,4  | ?     | ?                        |

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

02- لتكن لديك المعطيات المبينة في الجدول التالي:

| معدل العائد المتوقع (%) |           |           |       |                          |
|-------------------------|-----------|-----------|-------|--------------------------|
| السنة                   | المحفظة A | المحفظة B | السوق | الأصل الخالي من المخاطرة |
| 2011                    | 26,3      | 25,4      | 24,2  | 4,7                      |
| 2012                    | 14,2      | 21,7      | 14,1  | 4,3                      |
| 2013                    | 17,5      | 9,2       | 6,5   | 4,5                      |
| 2014                    | 18,7      | 8,4       | 9,3   | 5,8                      |
| 2015                    | 23,6      | 18,5      | 11,5  | 6,2                      |
| 2016                    | 27,5      | 14,2      | 17,4  | 6,5                      |
| 2017                    | 7,9       | 5,4       | 3,7   | 7,8                      |
| 2018                    | 27,5      | 14,2      | 17,4  | 6,5                      |
| 2019                    | 7,9       | 5,4       | 3,7   | 7,8                      |

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؟.