

السنة الجامعية: 2020/2019
يوم الثلاثاء 22 سبتمبر 2020

قسم علوم التسيير
السنة الثانية ماستر تخصص إدارة مالية

امتحان الديون للسنة الأولى ماستر
مقياس: تسيير المحافظ المالية

التمرين الأول
عرف المحفظة المالية.

التمرين الثاني

كم يمكن تشكيل محفظة من خلال أصلين ماليين؟ لماذا؟

التمرين الثالث

أوجد المحفظة ذات أدنى تباين التي تتكون من أصلين ماليين، حيث عائد الأصل الأول 5% أما الثاني 7%. بينما الانحراف المعياري للأصل الأول 3% والثاني 4%، معامل الارتباط بينهما معدوم.