

النموذج الأول

- ٢٣- تفضل الصناديق.....اختيار قطاع صاعد للاستثمار فيه.
- ٢٤- إذا كنت ترغب في الاستثمار في شركات حديثة التأسيس، فإن نمط الصندوق الأنسب إليك هو.....
- ٢٥- يعرف عدم قدرة الشركة علي الوفاء بالتزاماتها علي المدى القصير ب.....
- ٢٦- عند تحديد المحفظة المثلي للمستثمر، يجب أن توضع تفضيلات المستثمر من حيثفي الاعتبار
- ٢٧- يستخدم الترجيح بالوزن النسبي للاستثمار في ورقة مالية معينة بالنسبة لحجم الاستثمار، في حساب العائد.....
- ٢٨- إذا لم يستطيع المستثمر في سوق ما الوصول للمعلومات الكافية عن الورقة المالية، مما صعب التنبؤ بالعائد المستقبلي ومستوي المخاطر". بناء علي ذلك فإن المستثمر يتعرض إلي مخاطر عدم التأكد.
- ٢٩- تحتوي المحفظة المالية علي استثمارات حقيقية كالذهب والمعادن.
- ٣٠- تفضل defensive strategy عند الاستثمار في شركات الأدوية وشركات الصناعات الغذائية.
- ٣١- تهدف صناديق العائد الدوري إلي تعظيم الثروات طويلة الأجل.
- ٣٢- تهدف صناديق النمو الرأسمالي إلي الاستثمار في شركات ذات امكانية نمو مرتفعة.
- ٣٣- تقع المحفظة المثلي فوق منحنى منفعة المستثمر.
- ٣٤- تحمي الصناديق المنخفضة المخاطر المستثمر من مخاطر الركود والكساد.
- ٣٥- تتعرض صناديق النقد لمخاطر أقل من صناديق راس المال.
- ٣٦- تنفيذ استراتيجية تسلسل تواريخ الاستحقاق في تحقيق سيولة للمستثمر.
- ٣٧- يحقق الخيار الأمريكي علاوة مرتفعة ومخاطر مرتفعة.
- ٣٨- تحتوي المحفظة المالية علي استثمارات حقيقية كالذهب والمعادن.
- ٣٩- تلعب شركات الوساطة دورا في استرداد وثائق الصندوق المفتوح.
- ٤٠- يهدف المستثمر الراشد إلي الوصول بمحفظته لمخاطر مماثلة للمخاطر غير المنظمة.
- ٤١- بنيت نظرية المحفظة علي فرضية أن المستثمر ضوضائي.
- ٤٢- تتأثر الأسهم ووثائق الاستثمار بمخاطر الائتمان.
- ٤٣- تنعكس ميول المستثمر للمخاطر في صورته دالة مقعده.
- ٤٤- تحقق صناديق الاستثمار أرباح للمستثمر ذو المدخرات الضئيلة.
- ٤٥- يتحدد سعر الوثيقة في الصندوق المغلق بناء علي آليات العرض والطلب.
- ٤٦- الهدف الرئيسي للصناديق المتنوعة هو تفادي المخاطر الغير منتظمة.
- ٤٧- تؤدي principle risk إلي فقدان قيمة الأصل وأرباحه.
- ٤٨- يتم تنفيذ الخيار الأمريكي في نهاية عقد الخيار.
- ٤٩- يقل مستوي مخاطر عقد الخيار الأوروبي عن مستوي مخاطر عقد الخيار الأمريكي.
- ٥٠- يحمي خيار البيع من مخاطر انخفاض السعر.

❖ حدد أي من العبارات التالية صحيح، وأي منها خطأ:

العباره الصحيح(أ)، العباره الخاطئة (ب).

- ٢٨- إذا لم يستطيع المستثمر في سوق ما الوصول للمعلومات الكافية عن الورقة المالية، مما صعب التنبؤ بالعائد المستقبلي ومستوي المخاطر". بناء علي ذلك فإن المستثمر يتعرض إلي مخاطر عدم التأكد.
- ٢٩- تحتوي المحفظة المالية علي استثمارات حقيقية كالذهب والمعادن.
- ٣٠- تفضل defensive strategy عند الاستثمار في شركات الأدوية وشركات الصناعات الغذائية.
- ٣١- تهدف صناديق العائد الدوري إلي تعظيم الثروات طويلة الأجل.
- ٣٢- تهدف صناديق النمو الرأسمالي إلي الاستثمار في شركات ذات امكانية نمو مرتفعة.
- ٣٣- تقع المحفظة المثلي فوق منحنى منفعة المستثمر.
- ٣٤- تحمي الصناديق المنخفضة المخاطر المستثمر من مخاطر الركود والكساد.
- ٣٥- تتعرض صناديق النقد لمخاطر أقل من صناديق راس المال.
- ٣٦- تنفيذ استراتيجية تسلسل تواريخ الاستحقاق في تحقيق سيولة للمستثمر.
- ٣٧- يحقق الخيار الأمريكي علاوة مرتفعة ومخاطر مرتفعة.
- ٣٨- تحتوي المحفظة المالية علي استثمارات حقيقية كالذهب والمعادن.
- ٣٩- تلعب شركات الوساطة دورا في استرداد وثائق الصندوق المفتوح.
- ٤٠- يهدف المستثمر الراشد إلي الوصول بمحفظته لمخاطر مماثلة للمخاطر غير المنظمة.
- ٤١- بنيت نظرية المحفظة علي فرضية أن المستثمر ضوضائي.
- ٤٢- تتأثر الأسهم ووثائق الاستثمار بمخاطر الائتمان.
- ٤٣- تنعكس ميول المستثمر للمخاطر في صورته دالة مقعده.
- ٤٤- تحقق صناديق الاستثمار أرباح للمستثمر ذو المدخرات الضئيلة.
- ٤٥- يتحدد سعر الوثيقة في الصندوق المغلق بناء علي آليات العرض والطلب.
- ٤٦- الهدف الرئيسي للصناديق المتنوعة هو تفادي المخاطر الغير منتظمة.
- ٤٧- تؤدي principle risk إلي فقدان قيمة الأصل وأرباحه.
- ٤٨- يتم تنفيذ الخيار الأمريكي في نهاية عقد الخيار.
- ٤٩- يقل مستوي مخاطر عقد الخيار الأوروبي عن مستوي مخاطر عقد الخيار الأمريكي.
- ٥٠- يحمي خيار البيع من مخاطر انخفاض السعر.

النموذج الأول

- ٥١- يلزم عقد الخيار حامله بشراء أو بيع الأصل محل العقد.
٥٢- يتحمل حامل الخيار مخاطر غير محدودة نظير أرباح محدودة.
٥٣- يعبر الانحراف المعياري عن حجم المخاطر التي تتعرض لها كل وحدة من وحدات العائد.
٥٤- يعطي الانحراف المعياري معلومات دقيقة عندما لا تتساوى القيم المتوقعة لعوائد البدائل الاستثمارية.
٥٥- معامل الاختلاف هو المقياس الأنقى للمخاطر.
٥٦- ارتفاع معامل بيتا عن الواحد الصحيح يعني أن المستثمر قد يتحمل خسائر تفوق خسائر السوق.
- ❖ أجب عن الحالة التالية: (علما بأنه لن يؤخذ في الاعتبار إلا الناتج النهائي الذي ظللته في ورقة

إجابتك

"إذا توافرت لديك المعلومات التالية حول مقاييس إحدى المحافظ المالية، حيث تتألف تلك المحفظة من أربعة أسهم، والفرق بين مجموع متوسطات العائد الفعلي للأسهم الأربعة هو 504، في ضوء ذلك أجب عما يلي:

٥٧- احسب الانحراف المعياري للمحفظة، إذا علمت أن البيانات المذكورة عن هذه المحفظة بيانات فعلية.

(أ) 12.96 (ب) 11.22 (ج) 8.3 (د) لا شيء مما سبق

٥٨- احسب الانحراف المعياري للمحفظة إذا علمت أن البيانات المذكورة عن هذه المحفظة بيانات متوقعة.

(أ) 12.96 (ب) 11.22 (ج) 8.3 (د) لا شيء مما سبق

٥٩- إذا كان العائد المتوقع لهذه المحفظة هو 16%، احسب معامل الاختلاف للمحفظة ذات العائد المتوقع.

(أ) 0.81 (ب) 0.9 (ج) 0.7 (د) لا شيء مما سبق

٦٠- معيار الاختيار الأمثل للمحفظة هو اختيار المحفظة ذات.....

(أ) مستوى معامل اختلاف منخفض (ب) المدى المرتفع.

(ج) تقلبات عالية. (د) لا شيء مما سبق

انتهت الأسئلة

مع خالص دعائي إليكم أحيائي بالتوفيق والسداد

د/ غادة صلاح الدين أبو العطا