

# المحاضرة السابعة

الدكتور: حيدى آدم

### 3. قياس عوائد المحفظة المالية:

□ قياس عائد محفظة مكونة من أصلين؛

□ قياس عائد محفظة مكونة من  $n$  أصل؛

## ثانياً: المخاطر أنواعها وقياسها .

1. مفهوم المخاطر في الأوراق المالية.

2. أنواع المخاطر في الأوراق المالية:

أ. المخاطر المنتظمة:

□ مخاطر تغيير أسعار الفائدة؛

□ مخاطر التضخم؛

□ مخاطر السوق؛

□ المخاطر السياسية.

## ب. المخاطر غير المنتظمة:

□ مخاطر الأعمال؛

□ مخاطر التمويل؛

□ مخاطر السيولة.

### 3. طرق قياس المخاطر:

قياس المخاطر باستخدام مقاييس التشتت:

✓ المدى؛

✓ الانحراف المعياري  $\sigma$  ومربعه التباين؛

✓ معامل الاختلاف؛

✓ معامل التحديد.

قياس المخاطر باستخدام معامل بيتا.

□ قياس مخاطر محفظة مكونة من أصلين؛

□ قياس مخاطر محفظة مكونة من  $n$  أصل؛