

(અ) પરંપરાગત વિરૂદ્ધ આધુનિક પોર્ટફોલિયો વિશ્લેષણ ચર્ચો.

(૧૦)

(૧) નીચે જણાવેલ બજાર મૂલ્ય અને બીટા ધરાવતાં સ્ટોક્સમાં રોકેલ ઈક્વિટી ભંડોળનું સંચાલન એક રોકાણ કંપની કરે છે.

(૦૭)

સ્ટોક્સ	બજાર મૂલ્ય	બીટા
અ	૧૦૦૦૦૦	૧.૧
બ	૨૫૦૦૦	૧.૨
ક	૫૦૦૦૦	૦.૭૫
ડ	૧૨૫૦૦૦	૦.૬૦
ઈ	૧૬૫૦૦૦	૧.૩૦

જો ટી-બિલ્સ ઉપર વળતર ૭% હોય અને અંદાજિત બજાર વળતર ૧૪% હોય તો પોર્ટફોલિયોનું વળતર કેટલું રહેશે?

અથવા

પ્ર. ૪

(અ) પોર્ટફોલિયોના વળતર અને જોખમના ખ્યાલને સ્પષ્ટ કરો. પોર્ટફોલિયો જોખમને કેવી રીતે માપશો?

(૧૦)

(બ) શ્રીમાન વેદાંત નીચે મુજબનો પોર્ટફોલિયો ધરાવે છે.

(૦૭)

શેર	બીટા	રોકાણ (₹)
એનટીપીસી	૦.૬	૩૦૦૦૦૦
તાતા મોટર્સ	૧.૦	૧૮૦૦૦૦
પીએનબી	૧.૨	૧૨૦૦૦૦

જો જોખમ મુક્ત દર ૬% અને બજાર પોર્ટફોલિયો ઉપર અંદાજિત વળતર ૧૫% હોય તો શ્રીમાન વેદાંતના પોર્ટફોલિયોનો અંદાજિત વળતરનો દર શો હશે?