

2007同等学力工商管理冲刺复习之财务管理案例分析例题2

PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/235/2021_2022_2007_E5_90_8C_E7_AD_89_c69_235037.htm

1. 某企业持有甲、乙、丙三种股票构成的证券组合，其

$\beta = 1.2 \times 40\% + 1.6 \times 35\% + 0.8$

$\times 25\% = 1.24$
 $R_p = 1.24 \times (10\% - 6\%) + 6\%$

$= 10.96\%$ (2) 由于该组合的收益率 (10.96%) 低于企业要求的

收益率 (13%)，因此可以通过提高 β 系数高的甲或乙

种股票的比重、降低丙种股票的比重实现这一目的。100Test

下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问

www.100test.com