

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](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 $\alpha$  =  $1.2 \times 40\% + 1.6 \times 35\% + 0.8 \times 25\% = 1.24$

$$R_p = 1.24 \times (10\% - 6\%) = 4.96\% \quad k_i = 6\% \\ 6.2\% = 10.96\% \quad (2)$$

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 $\alpha$ 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](http://www.100test.com)