

中级职称会计财务管理易错点第二章 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/258/2021_2022__E4_B8_AD_E7_BA_A7_E8_81_8C_E7_c44_258150.htm 第二章：协方差 = 相关系数 × 单项资产收益率标准差 × 市场组合资产率标准差
贝他系数 = 相关系数 × 单项资产收益率标准差 / 市场组合资产率标准差
风险收益率 = 风险价值系数 × 标准离差率
注意公式中标准离差和标准离差率的不同
假设市场均衡时，预期收益率 = 资本资产定价模型下的必要收益率，在此情形下，贝他系数和相关系数可以相互推算。
无风险资产的标准差、贝他系数和相关系数为0，市场组合的贝他系数和相关系数为1。
方差为0.64，标准差为0.8，方差为0.64%，标准差为8%。

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