

第三章证券投资收益与风险计量分析小结 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/39/2021\\_2022\\_\\_E7\\_AC\\_AC\\_E4\\_B8\\_89\\_E7\\_AB\\_A0\\_E8\\_c33\\_39484.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/39/2021_2022__E7_AC_AC_E4_B8_89_E7_AB_A0_E8_c33_39484.htm) 1、 证券投资的期望收益率 = 每种情况概率 × 单位位收益率 2、 证券投资组合的期望收益率 = 证券在组合中比例 × 证券期望收益率 3、 单期收益率 = 资本利得收益率 + 现金股利收益率 4、 多期收益率 = (1 + 各期收益率) 连乘积 = (1 + R1)(1 + R2)...(1 + Rn) 5、 多期平均收益率包括简单算术平均收益率、几何平均收益、价值加权平均收益率。 6、 债券的收益率有：现期收益率、单利最终收益率、复利最终收益率、再投资收益率。 7、 系统性风险指的是总收益变动中由影响所有股票价格的因素造成的那一部分。非系统性风险是总风险中对一个公司或一个行业是独一无二的那部分风险 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)