

证券投资分析第三章 有价证券风险与收益 PDF转换可能丢失
图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/41/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E6_8A_95_E8_c33_41045.htm

引言：证券价格受到诸多因素的影响，形成了证券价格的不确定性。这种未来价格的不确定性体现了证券投资的风险。证券市场的内在特性决定了其是一个高风险的金融市场。风险和收益如同一对孪生兄弟有着密切的联系。研究投资组合的收益必须对其面临的风险加以衡量。证券市场的风险来自不同的因素，可以分为两大方面：系统风险和非系统风险。马柯威茨提供了风险衡量的数理模型，在此基础上得出了资本市场线和证券市场线对投资决策有着重要的意义。由专业人士组成的信用评估机构，建立一个证券信用评估体系，对于证券市场的成熟与完善有着重要的意义。学员在学习本讲过程中要重点把握马柯威茨模型，以及资本市场线和证券市场线。一定的高等数学基础是学习本讲的关键。

目录 第一节 投资风险与收益的关系
第二节 有价证券收益衡量 第三节 有价证券风险衡量 第四节 马柯威茨模型与投资组合

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