

证券组合管理理论证券组合分析 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_E7_BB_84_E5_c33_41608.htm 第二节 证券组合分析

主要介绍单个证券的收益和风险、证券组合的收益和风险、证券组合的可行域和有效边界、最优证券组合四部分内容。

第一部分 单个证券的收益和风险在股票投资中，投资收益等于期内股票红利收益和价差收益之和。风险的大小由未来可能

收益率与期望收益率的偏离程度来反映。第二部分 证券组合的收益和风险一、两种证券组合的收益和风险

$E(r_P) = x_A E(r_A) + x_B E(r_B)$
 $\sigma_P^2 = x_A^2 \sigma_A^2 + x_B^2 \sigma_B^2 + 2x_A x_B \sigma_A \sigma_B \rho_{AB}$
AB : 相关系数

； σ_{AB} : 协方差，记为 $COV(A, B)$ 二、多种证券组合的收益和风险 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