

2008年100test每日一练财务管理(6月16日) PDF转换可能丢失
图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/504/2021_2022_2008_E5_B9_B4100_c44_504002.htm 多项选择题 风险控制对策包括（ ）

。 A.规避风险B.减少风险C.转移风险D.回避风险 正确答案

: ABC 答案解析：风险控制对策包括：规避风险、减少风险、转移风险和接受风险。 计算某资产的贝他系数时，涉及

（ ）。 A.该资产的收益率与市场组合收益率的相关系数 B.该资产收益率的标准差 C.市场组合收益率的标准差 D.该资产的收益率与市场组合收益率的协方差 正确答案：ABCD 答案解析：

某资产的贝他系数 = 该资产的收益率与市场组合收益率的协方差 / 市场组合收益率的方差 = (该资产的收益率与市场组合收益率的相关系数 × 该资产收益率的标准差 × 市场组合收益率的标准差) / (市场组合收益率的标准差 × 市场组合收益率的标准差) = 该资产的收益率与市场组合收益率的相关系数 × 该资产收益率的标准差 / 市场组合收益率的标准差。

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