

2009年证券投资基金每日一练（4月23日）证券从业资格考试
PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/587/2021_2022_2009_E5_B9_B4_E8_AF_81_c33_587758.htm

单选题已知证券组合P是由证券A和B构成，两者的收益、标准差以及相关关系如下：证券名称 期望收益率 标准差相关系数投资比重

A 10% 6% 0.12 30% B 5% 2% 70% 组合P的方差为（ ）。 A

. 0.0467 B . 0.00052 C . 0.0327 D . 0.03266 【正确答案】： C 【参考解析】： 方差 = $0.3^2 \times 0.06^2 + 0.7^2 \times 0.02^2 + 2 \times 0.3 \times 0.7 \times 0.06 \times 0.02 \times 0.12 = 0.0327$ 编辑推荐：好资料快收藏，百考试题证券站 百考试题证券在线模拟系统，海量题库2009年证券从业考试远程辅导，热招中！百考试题特别推荐：2009年证券投资基金每日一练3月试题汇总2009年证券投资基金每日一练2月试题汇总2009年证券投资基金每日一练1月试题汇总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