

2009年证券投资分析每日一练（4月26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\\_ti2020/645/2021\\_2022\\_2009\\_E5\\_B9\\_B4\\_E8\\_AF\\_81\\_c33\\_645113.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/645/2021_2022_2009_E5_B9_B4_E8_AF_81_c33_645113.htm) 单选题已知证券组合由A和B构成，证券A和B的期望收益分别为10%和5%，证券A和B的标准差分别为6%和2%，两种证券的相关系数为0.12，组合的方差为0.0327，则该组合投资于证券B的比重为（ ）。 A . 70% B . 30% C . 60% D . 40% 【正确答案】： A 【参考解析】： 根据公式，两证券组合的方差，并且 $X_A + X_B = 1$ ，将上述数据代入 $X_B = 70\%$ 得。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年证券投资分析每日一练3月试题汇总2009年证券投资分析每日一练2月试题汇总2009年证券投资分析每日一练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](http://www.100test.com)