

2023-2024学年度第二学期 ★ 金融学概论本科双学位班

**本文件内容为涉密信息，严禁私自散布；违者一经查实，取消课程考试资格**

**平时作业2**

完成时间**：2024年6月16~22日**

计算题

1．某投资者正在评估A、B两公司普通股的期望收益率，目前已收集到的信息如下：

（1）市场无风险利率为3.85%；

（2）市场组合的期望收益率为12.85%；

（3）A公司普通股的贝塔系数为4.89；

（4）B公司普通股的贝塔系数为3.62。

试根据资本资产定价模型原理，分别计算A、B两公司普通股的期望收益率。

（本题目分值：10分；占本课程总成绩比例：10%）

2．某投资者构建了一个风险资产组合，该组合的期望收益率为16.42%，标准差为6.35%。假设该投资者的风险厌恶系数为2.5，试求其效用值。

（本题目分值：5分；占本课程总成绩比例：5%）

要求严格按以下步骤完成：

（1）在本文件名的对应位置，替换个人信息（余处勿动）。

（2）用纯空白A4打印纸，全程手工书写完成本题目答案后，手机高清拍照并剪贴至本文件下方空白处。

（3）须列出计算公式及详细步骤，保持计算过程的完整性。

（4）细致核对后，以Word/PDF双格式提交至任课教师邮件：

[nkzhangzengwei@126.com](mailto:nkzhangzengwei@126.com)。



