

非系统风险可以消除吗、指数基金能消除投资组合的非系统风险????-股识吧

一、构建证券组合是降低系统性风险还是非系统风险

证券组合理论认为，证券组合的风险随着组合所包含证券数量的增加而降低，尤其是证券间关联性极低的多元化证券组合可以有效的降低非系统风险，使证券组合的投资风险趋向于市场平均风险水平。

因此，组合管理强调构成组合的证券应多元化。

非系统风险又称非市场风险或可分散风险。

它是与整个股票市场或者整个期货市场或外汇市场等相关金融投机市场波动无关的风险，是指某些因素的变化造成单个股票价格或者单个期货、外汇品种以及其他金融衍生品种下跌，从而给有价证券持有人带来损失的可能性。

非系统风险主要特征：1、它是由特殊因素引起的，如企业的管理问题、上市公司的劳资问题等。

2、它只影响某些股票的收益。

它是某一企业或行业特有的那部分风险。

如房地产业投票，遇到房地产业不景气时就会出现景跌。

3、它可通过分散投资来加以减少，但并不能完全消除。

由于非系统风险属于个别风险，是由个别人、个别企业或个别行业等可控因素带来的，因此，股民可通过投资的多样化来化解非系统风险。

二、证券投资非系统性风险指什么，举例说明。

风险，最简单的定义是“风险是发生财务损失的可能性”，风险分为单项资产的风险和投资组合的风险，投资组合理论认为，若干种证券组成的投资组合，其收益是这些证券收益的加权平均数，但是其风险不是这些证券风险的加权平均风险，投资组合能降低风险.在投资组合中，个别资产的风险，有些可以被分散掉，有些则不能.无法分散掉的是系统风险，可以分散掉的是非系统风险.系统风险是指那些影响所有公司的因素引起的风险，如战争、经济衰退、通货膨胀、高利率等非预期的变动，对许多资产都会有影响，例如，各种股票处于同一经济系统之中，它们的价格变动有趋同性，多数股票的报酬率在一定程度上正相关。经济繁荣时，多数股票的价格都上涨，经济衰退时，多数股票的价格下跌。尽管涨跌的幅度各股票有区别，但是多数股票的变动方向是一致的。所以不管投资多样化有多充分，也不可能消除

全部风险，即使购买的是全部股票的市场组合。非系统风险，是指发生于个别公司的特有事件造成的风险，例如，公司的工人罢工，新产品开发失败，失去重要的销售合同，诉讼失败或宣告发现新矿藏，取得一个重要合同等。这类事件是非预期的，随机发生的，它只影响一个或少数公司，不会对整个市场产生太大的影响。这种风险可以通过多样化投资来分散，即发生于一家公司的不利事件可以被其他公司的有利事件所抵消。由于非系统风险是个别公司或个别资产所特有的，所有也称“特有风险”，由于非系统风险可以通过投资多样化分散掉，也称“可分散风险”。由于非系统风险可以通过分散化消除，因此一个充分的投资组合几乎没有非系统风险，假设投资人都是理智的，都会选择充分投资组合，非系统风险将与资本市场无关。市场不会对它给予任何价格补偿。通过分散化消除的非系统风险，几乎没有任何值得市场承认的，必须花费的成本。选自08年CPA教材 < 财务成本管理 >

三、1. 为什么非系统性风险能够通过多元化进行分散，而系统性风险则无法分散？

四、股票市场的系统风险和非系统风险 股票指数期货能减少或消除哪一种风险

当然是系统风险。

所谓系统风险就是：个股和大盘的相关性，大盘就是股指，比如上证指数。

通常，上证指数涨，个股就涨，上证指数跌，个股就跌，跟指数一起

一起涨一起跌，就是系统风险。

非系统风险不管大盘的事，不管指数的事，比如他们公司自己经营出了乱子，自己经营的好，都是自己的事，跟指数关系不大。

除非是大盘股，权重大的股指成分股。

五、指数基金能消除投资组合的非系统风险？？？？

非系统风险又称非市场风险或可分散风险。

它是与整个股票市场的动无关的风险，是指某些因素的变化造成单个股票价格下跌

，从而给股票持有人带来损失的可能性。

1. 它是由特殊因素引起的，如企业的管理问题、上市公司的劳资问题等。

2. 它只影响某些股票的收益。

它是某一企业或行业特有的那部分风险。

如房地产业投票，遇到房地产业不景气时就会出现景跌。

3. 它可通过分散投资来加以消除。

由于非系统风险属于个别风险，是由个别人、个别企业或个别行业等可控因素带来的，因此，股民可通过投资的多样化来化解非系统风险。

而指数基金属于被动投资，也就是说在指定的范围，比如沪深300里面选股、、、这样就降到了非系统风险

六、为什么非系统性风险能够通过多元化进行分散，而系统性风险则无法分散？

非系统性风险是指对某个行业或个别证券产生影响的风险，它通常由某一特殊的因素引起，与整个证券市场的价格不存在系统的全面联系，而只对个别或少数证券的收益产生影响。

所以如果你没买这支股票或这个行业的股票，分散投资自然就分散了。

而系统性风险即市场风险，即指由整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格所造成的影响，所以既然整个证券市场都这样，您买哪个股票又能分散呢？

七、无论如何进行证券投资组合，人们只能减少非系统风险而不能消除非系统风险。-判断题，正确还是错误。

正确 非系统风险不能消除的

参考文档

[下载：非系统风险可以消除吗.pdf](#)

[《上市股票中签后多久可以卖》](#)

[《一般股票持有多久才能赚钱》](#)

[《启动股票一般多久到账》](#)

[《一只股票从增发通告到成功要多久》](#)

[下载：非系统风险可以消除吗.doc](#)
[更多关于《非系统风险可以消除吗》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/author/75625341.html>