

第七章证券组合管理习题（11）简答题五 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/41/2021_2022__E7_AC_AC_E4_B8_83_E7_AB_A0_E8_c33_41164.htm（七）简答题五

61.采用债券市场线对债券组合在某一给定季度（或某一给定年度）的业绩进行评估必须经过哪些步骤？62.什么是詹森指数？63.什么是特雷诺指数？64.什么是夏普指数？65.有哪些评价证券组合经营业绩的指标？这些指标各反映经营业绩的哪些特性？66.已知投资者的无差异偏好曲线方程为： $EP = \frac{P^2}{2}$ 其中： P 表示组合P的标准差， EP 表示组合P的期望收益率， $\frac{1}{2}$ 是参数。怎样确定该投资者所应选择的最优证券组合？说明理由。67.什么是风险容忍度？68.依据现代组合管理理论对股票投资实施管理，其管理方式有几种类型？各有什么区别？69.概要介绍运用现代组合投资理论对证券实施分析、构造股票资产组合的实际操作方式。70.根据现代组合投资理论，投资者应按什么原则选择市场时机？为什么？71.一般而言，不同的投资者会具有相同的证券组合可行域吗？为什么？答案：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