

第七章证券组合管理习题（10）简答题四 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\\_41169.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/41/2021_2022__E7_AC_AC_E4_B8_83_E7_AB_A0_E8_c33_41169.htm)（七）简答题四 46.资本资产套利模型的核心应用是什么？ 47.什么是平均期限？平均期限与债券价格的利率风险有什么关系？ 48.假设单一支付情形下的负债人将债权人的本金投资于一种债券或债券组合，并对其实施被动管理。那么，为确保在到期日能够偿付债权人的本金和利息，该负债人应使他的债券或债券组合具备什么特性？为什么？ 49.假设负债人将债权人的本金投资于一种债券或债券组合，以期从中获得充足的资金来偿还未未来债务。在多重支付的情形下，负债人对其债券或债券组合实施免疫资产管理策略的要点是什么？ 50.为什么水平分析法集中估计期末债券价格？ 51.水平分析法中的资本收益率变动结构是什么？ 52.如何理解水平分析法中债券收益的结构？ 53.什么是水平分析法？ 54.什么是债券掉换？债券掉换的依据是什么？ 55.什么是应急免疫方法？它与免疫资产管理有什么不同？ 56.什么是骑乘收益率曲线法？ 57.什么是替代掉换？ 58.什么是市场内部价差掉换？ 59.什么是利率预期掉换？这种管理方法的依据是什么？ 60.什么是纯收益率掉换？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](http://www.100test.com)