

第七章证券组合管理习题(9)简答题三 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_41170.htm (七) 简答题三 31. 试根据由两种证券构建组合所形成的可行域的形状说明“由多种证券构建组合所形成的可行域的左边界总是向外凸的, 不会出现凹陷”。 32. 资本资产定价模型的假设条件可概括为哪几条? 33. 什么是市场证券组合? 它成为最优风险证券组合的条件是什么? 34. 什么是资本市场线? 它有什么经济意义? 画出资本市场线草图。 35. 什么是证券市场线? 它有什么经济意义? 画出证券市场线的草图。 36. 写出证券市场线方程, 并说明方程中各变量的涵义。 37. 什么是证券特征线? 38. 写出证券*i*的实际收益率与市场组合实际收益率间的回归直线方程, 并说明方程中各变量的涵义。 39. 写出描述证券*i*的实际收益率与市场组合实际收益率之间关系的回归模型, 并说明模型中各变量的涵义。 40. 什么是证券的 β 系数? 它有什么经济意义? 41. 什么是证券的 α 系数? 它有什么经济意义? 42. 假设证券市场的市场线近似为 $E_i = 0.06 + 0.19 \beta_i$ 其中: E_i 和 β_i 分别表示证券的期望收益率和 β 系数。试写出以价格形式表述的CAPM模型。 43. 什么是单因素模型? 44. 什么是多因素模型? 45. 什么是套利证券组合? 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