

第七章证券组合管理习题（8）简答题二 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_41172.htm（七）简答题二16.什么是马柯威茨单期投资问题？17.什么是证券的期望收益率？18.什么是证券的方差？19.马柯威茨均值方差模型的两个假设条件是什么？20.马柯威茨均值方差模型的两个假设条件及其意义是什么？21.试就不允许卖空和允许卖空两种情况分述由两种证券A和B构建组合所形成的可行域的形状，并画草图说明之。22.相关系数的经济意义是什么？23.假设A、B、C都是风险证券，试结合草图说明由A、B、C构建组合的可行域的形状。24.什么是有效边界？什么是有效组合？25.下表列示了六种证券的期望收益率和标准差。如果不允许构建组合，试从中找出有效的证券，并说明理由。26.根据马柯威茨均值方差模型的假设，所有投资者都将遵循一个不依赖于个人偏好的筛选原则在可行域中选择证券组合。这个原则是什么？27.什么是无差异曲线？28.什么是无差异曲线？它的经济意义和特征是什么？29.设两个投资者A和B各自的偏好无差异曲线族如图4所示。试比较二者的风险态度并作简要说明。30.为什么无差异曲线与有效边界相切的切点所对应的组合是最优证券组合（假设不存在无风险证券）？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