

第七章证券组合管理习题（4）多项选择题 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_41183.htm（四）多项选择题 1. 证券组合的分类通常以组合的投资目标为标准。以美国为例，证券组合的类型包括__等。 A.避税型 B.收入型 C.收入增长混合型 D.增长型 E.货币市场型 F.国际型 2.如果以组合的投资目标为标准对证券组合进行分类，那么，__是常见的证券组合类型。 A.增长型 B.指数化型 C.避税型 D.被动管理型 E.货币市场型 F.国际型 3.证券组合管理的主要内容包括__等。 A.计划 B.确定最优证券组合 C.选择证券 D.选择时机 E.监督 4.传统证券组合管理的基本步骤依次是__。 A.实施证券分析 B.对证券组合资产的经济效果进行评价 C.确定投资政策 D.构思证券组合资产 E.修订证券组合资产结构 5.以传统组合管理方式构思证券组合资产，一般应遵循的基本原则有__。 A.本金的安全性原则 B.基本收益的稳定性原则 C.资本增长原则 D.良好市场性原则 E.流动性原则 F.多元化原则 6.符合增长型证券组合标准的股票一般具有以下特征：__。 A.高派息 B.收入和股息稳步增长 C.收入增长率非常稳定 D.低派息 E.高预期收益 F.总收益高，风险低 7.分别于1964年、1965年和1966年提出著名的资本资产定价模型（CAPM）的经济学家依次是__。 A.罗尔 B.夏普 C.罗斯 D.林特 E.马柯威茨 F.摩森 8.现代证券组合理论的内容包括__等。 A.APT模型 B.交易需求的存货模型 C.均值一方差模型 D.因素模型 E.均衡模型 F.CAPM模型 9.马柯威茨模型的理论假设是__。 A.投资者以期望收益率（亦称收益率均值）来衡量未来实际收益率的总体水平，以收益率的方差

(或标准差)来衡量收益率的不确定性(风险),因而投资者在决策中只关心投资的期望收益率和方差 B.不允许卖空 C.投资者是不知足的和厌恶风险的,即投资者总是希望期望收益率越高越好,而方差越小越好 D.允许卖空 E.证券的供给量等于需求量 F.所有投资者都具有相同的有效边界 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