

证券从业人员资格考试证券投资练习题八 PDF转换可能丢失
图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/42/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E4_BA_BA_E4_c33_42024.htm 一、名词解释 1、证券投资
风险 2、系统性风险 3、非系统性风险 4、利率风险 5、
购买力风险 6、公司风险 7、市场风险 8、趋势投资计划调整
法 9、公式投资计划调整法 10、 β 系数 11、证券组合 二、
填空 1、证券投资风险按风险的性质划分为（ ）和（ ） 2、
证券投资风险按风险的来源可以划分为（ ）（ ）（ ）（ ）
（ ）。 3、调整证券组合的方法很多，常用的有（ ）（ ）两
种 4、证券投资组合的标准应能满足下列条件，即（ ）（ ）
（ ）（ ）（ ）（ ）等。 5、（ ）系数表明证券风险和市场
风险的相关程度 三、计算 某投资者的组合投资额 10 万元，
共 10 种股票，每种股票投资 1 万元，现有不同的投资组合三
种： 1）投资组合中各种股票的 $\beta = 0.8$ ； 2）投资组合
中一种股票售出，代之以 $\beta = 2$ 的另一种股票； 3）投资组
合中售出的股票被 $\beta = 0.6$ 的股票所取代；试计算以上几
种投资组合的 β 系数？ 四、简答 1、何谓证券投资风险？证
券投资风险有哪几种形式？ 2、描述证券投资风险与收益之
间的关系？ 3、证券投资风险测量有哪几种方法、如何测算
？ 4、怎样防范证券投资风险？ 5、什么是趋势投资计划调
整法和公式投资计划调整法？ 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