

2006年《证券投资分析》第七章练习题 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/42/2021_2022_2006_E5_B9_B4_E3_80_8A_c33_42042.htm

一、单项选择题 1. () 证券组合追求基本收益的最大化。 A. 避税型 B. 收入型 C. 增长型 D. 混合型 2. 资产组合理论证明，证券组合的风险随着组合所包含的证券数量的增加而()。 A. 降低 B. 增加 C. 不变 D. 不确定 3. 运用组合投资，可以降低、甚至排除()。 A. 系统风险 B. 非系统风险 C. 利率风险 D. 政策风险 4. 套利定价理论()。 A. 与传统资本资产定价模型完全相同 B. 研究的是非市场均衡下的资产定价问题 C. 借用了多因素模型 D. 专门研究组合投资的资金配置问题 5. 马柯威茨模型可被应用于()。 A. 价值评估 B. 资金配置 C. 确定市场风险 D. 计算个别风险 6. 在证券组合投资理论中，使用的英文缩写CAPM是指()。 A. 单因素模型 B. 均值方差模型 C. 资本资产定价模型 D. 多因素模型 7. 假定不允许卖空，当两个证券完全正相关时，这两种证券在均值标准差坐标系中的结合线为()。 A. 双曲线 B. 椭圆 C. 直线 D. 射线 8. 在以期望收益为纵坐标、均方差为横坐标的平面坐标系中，无差异曲线位置越高，表明其代表的满意程度()。 A. 越高 B. 越低 C. 趋于0 D. 趋于1 9. β 系数()。 A. 大于0小于1 B. 是证券市场线的斜率 C. 是衡量资产系统风险的指标 D. 是利用回归风险模型推导出来的 10. 证券市场线表明，在市场均衡条件下，证券(或组合)的收益由两部分组成，一部分是无风险收益，另一部分是()。 A. 对总风险的补偿。 B. 对放弃即期消费的补偿 C. 对系统风险的补偿 D. 对非系统风险的补偿 二、多项

选择题 1 . 根据投资目标划分 , 证券组合的类型包括()。 A . 避税型组合 B . 增长型组合 C . 股票组合 D . 债券组合 2 . 证券组合管理特点主要表现在()。 A . 投资的分散性 B . 获得最大投资收益 C . 使得投资风险最小 D . 风险与收益的匹配性 3 . 任何类型的证券组合都必须考虑的原则有()。 A . 本金的安全性 B . 收益最大化 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