

证券业从业人员资格考试模拟试题 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/44/2021\\_2022\\_\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_88\\_B8\\_E4\\_B8\\_9A\\_E4\\_c33\\_44518.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/44/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E4_B8_9A_E4_c33_44518.htm) 一、名词解释（18分）

1、临界线 2、有效益资产组合边界 3、系统风险与非系统风险 4、市场组合 5、收益线 6、组合线 三、计算题（20分）

1、利用CAPM填下表：股票预期收益标准差贝塔值残差的方差

10.15% 2.000.102% 0.250.750.0430.09% 0.500.17 2、已知市场指数方差为0.4 股票权数贝塔值方差

10.60.80.520.40.30.3 计算这两种股票资产组合的方差。 四、论述题（20分）分析比较基础分析方法、技术分析方法和数量化方法这三种投资管理方法的优点和局限性。 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](http://www.100test.com)