

2008年证券考试证券投资分析试题集(八)证券从业资格考试
PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/645/2021_2022_2008_E5_B9_B4_E8_AF_81_c33_645414.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？

百考试题收集整理 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