

2010年证券从业考试《投资分析》章节模拟题(7) PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/647/2021\\_2022\\_2010\\_E5\\_B9\\_B4\\_E8\\_AF\\_81\\_c33\\_647359.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/647/2021_2022_2010_E5_B9_B4_E8_AF_81_c33_647359.htm) 第 9 页：答案部分 第七章 证券

组合管理理论(答案解析) 一、单项选择题 1.避税型证券组合通常投资于( )。 A.免税债券 B.付息债券 C.国库券 D.优先股 2.完全正相关的证券A和证券B，其中证券A的期望收益率为16%，标准差为6%，证券B的期望收益率为20%，标准差为8%。如果投资证券A、证券B的比例分别为30%和70%，则证券组合的期望收益为( )。 A.16.8% B.17.5% C.18.8% D.19%

3.完全正相关的证券A和证券B，其中证券A的期望收益率为16%，标准差为6%，证券B的期望收益率为20%，标准差为8%。如果投资证券A、证券B的比例分别为30%和70%，则证券组合的标准差为( )。 A.3.8% B.7.4% C.5.9% D.6.2%

4.完全负相关的证券A和证券B，其中证券A的期望收益率为16%，标准差为6%，证券B的期望收益率为20%，标准差为8%。如果投资证券A、证券B的比例分别为30%和70%，则证券组合的标准差为( )。 A.3.8% B.7.4% C.5.9% D.6.2%

5.完全不相关的证券A和证券B，其中证券A的期望收益率为16%，标准差为6%，证券B的期望收益率为20%，标准差为8%。如果投资证券A、证券B的比例分别为30%和70%，则证券组合的标准差为( )。 A.3.8% B.7.4% C.5.9% D.6.2%

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)