

2010证券从业资格考试《投资分析》精讲班习题(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_E8_AF_81_E5_88_B8_c33_647454.htm 第3页：二、多项选择题第5

页：三、判断题第6页：参考答案第8页：二、多项选择题

第9页：三、判断题 2010年证券从业资格全科套餐，七折优惠，并赠送100元模考卡！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%，

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%

6、()表示的就是按照现值计算，投资者能够

收回投资债券本金的时间(用年表示),也就是债券期限的加权平均数,其权数是每年的债券利息或本金的现值占当前市价的比重。A、凸性 B、到期期限 C、久期 D、获利期

7、夏普指数是()。 A、连接证券组合与无风险资产的直线的斜率 B、连接证券组合与无风险证券的直线的斜率 C、证券组合所获得的高于市场的那部分风险溢价 D、连接证券组合与最优风险证券组合的直线的斜率

8、适合入选收入型组合的证券有()。 A、高收益的普通股 B、优先股 C、高派息风险的普通股 D、低派息、股价涨幅较大的普通股

9、特雷诺指数是()。 A、连接证券组合与无风险资产的直线的斜率 B、连接证券组合与无风险证券的直线的斜率 C、证券组合所获得的高于市场的那部分风险溢价 D、连接证券组合与最优风险证券组合的直线的斜率

10、夏普、特雷诺和詹森分别于1964年、1965年和1966年提出了著名的()。 A、套利定价模型 B、有效市场理论 C、期权定价模型 D、资本资产定价模型

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