

证券投资基金第十一章证券组合管理基础 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/38/2021\\_2022\\_\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_88\\_B8\\_E6\\_8A\\_95\\_E8\\_c33\\_38729.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/38/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E6_8A_95_E8_c33_38729.htm) 基本内容：本章主要介绍了证券组合管理理论以及资本资产定价模型、套利定价模型、有效市场假设理论，最后介绍了行为金融理论。学习要求：了解证券组合管理的概念；熟悉现代投资理论的产生与发展。了解证券投资组合理论的基本假设和应用；熟悉单个证券和证券组合的收益与风险衡量方法；熟悉风险分散原理；了解两种和多个风险证券组合的可行集与有效边界；了解无差异曲线的含义以及在最优证券组合中的运用。了解资本资产定价模型的含义、基本假设和应用；熟悉资本资产定价模型的推导。了解套利定价模型的含义、基本假设、应用和局限性；了解多因素模型、套利行为与套利组合；熟悉套利定价模型的推导。了解有效市场的基本概念、形式以及运用；了解行为金融理论的背景、理论模型及其运用。#8226. 第二节 投资组合理论及其运用重点内容：单个证券和证券组合的收益与风险衡量方法；风险分散原理。考点分析：证券分散化可以降低非系统风险，但系统风险不可避免。#8226. 第四节 套利定价模型及其运用重点内容：套利定价模型的推导。考点分析：套利定价模型无法指出风险资产价格影响因素。#8226. 第六节 行为金融理论及其应用重点内容：了解行为金融理论的背景、理论模型及其运用。考点分析：本节内容为了解。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)