

证券投资基金第十四章债券投资组合管理 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_38738.htm

基本内容：本章介绍了债券收益率及收益率曲线；债券风险的测量；积极债券组合管理和消极债券组合管理的理论基础和各种策略。具体对单一债券收益率的衡量方法、债券投资组合收益率的衡量方法、影响债券收益率的因素、收益率曲线的概念、几种主要的期限结构理论、债券风险种类、测算债券价格波动性的方法、债券流通性价值的计算方法、积极债券组合管理和消极债券组合管理的理论基础和各种策略进行了详细介绍。学习要求：熟悉债券投资组合收益率的衡量方法；了解影响债券收益率的因素；了解收益率曲线的概念；熟悉几种主要的期限结构理论。了解债券风险种类；熟悉测算债券价格波动性的方法；了解积极债券组合管理和消极债券组合管理的理论基础和各种策略。

#8226. 第二节 债券风险的衡量重点内容：风险种类、测算债券价格波动性的方法、流通性价值的衡量。

考点分析：风险的种类，如利率风险、再投资风险、流动性风险、经营风险、购买力风险、汇率风险、赎回风险；测算债券价格波动性的方法，久期、凸性；流通性价值的衡量

#8226. 第四节 消极债券组合管理重点内容：指数化投资策略，投资者对债券投资组合策略的选择。考点分析：指数化投资策略的目标，指数的选择，指数化的方法，指数化的衡量标准指数化的局限性，投资者对债券投资组合策略的选择

。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