

证券投资基金第十二章资产配置管理 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\\_38741.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/38/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E6_8A_95_E8_c33_38741.htm) 基本内容：本章主要介绍了资产配置管理的定义、基本方法，资产配置的主要类型和相互之间的比较。学习要求：熟悉资产配置的含义和主要考虑因素；了解资产配置管理的原因及目标；熟悉资产配置的基础步骤和动态的资产配置过程。了解资产配置的基本方法；熟悉历史数据法和情景综合分析法的主要特点及其在资产配置过程中的运用；熟悉有效市场前沿的确定过程和方法。了解资产配置的主要分类方法和类型；熟悉各类资产配置策略的一般特征以及在资产配置中的具体运用；熟悉战术性资产配置与战略性配置之间的异同。#8226. 第二节 资产配置的基本方法重点内容：历史数据法和情景综合分析法的主要特点及其在资产配置过程中的运用；有效市场前沿的确定过程和方法。考点分析：历史数据法以长期历史数据为基础，根据过去的经历推测未来的资产类别收益。情景综合分析法一般可以预测的区间是3-5年。&#8226. 第三节 资产配置的主要类型及其比较重点内容：各类资产配置策略的一般特征以及在资产配置中的具体运用；战术性资产配置与战略性配置之间的异同。考点分析：从配置策略上，资产配置的主要类型有买入并持有策略、恒定混合策略、投资组合保险策略和动态资产配置策略。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)