

第十一章投资组合管理基础 PDF转换可能丢失图片或格式，  
建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/40/2021\\_2022\\_\\_E7\\_AC\\_AC\\_E5\\_8D\\_81\\_E4\\_B8\\_80\\_E7\\_c33\\_40127.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/40/2021_2022__E7_AC_AC_E5_8D_81_E4_B8_80_E7_c33_40127.htm) 本章要点：了解证券组合管理的概念；熟悉现代投解基金组合管理的过程。了解证券投资组合理论的基本假设；熟悉单个证券和证券组合的收益风险衡量方法；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；了解资产组合理论的运用以及在运用中要注意的问题。了解资本资产定价模型的含义和基本假设；熟悉资本资产定价模型的推导。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)