

证券考试大纲第七章证券组合管理 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/41/2021\\_2022\\_\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_88\\_B8\\_E8\\_80\\_83\\_E8\\_c33\\_41253.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/41/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E8_80_83_E8_c33_41253.htm) 第七章 证券组合管理 第一节 证券组合管理概述 一、证券组合（一）证券组合的含义（二）构建证券组合的原因（三）证券组合的分类二、证券组合管理（一）主要内容（二）证券组合管理的理论基础 1、传统的证券组合管理理论 2、现代资产组合管理理论 三、证券组合管理发展史简述 第二节 传统的证券组合管理 一、传统的证券组合管理的基本步骤（一）确定投资政策（二）实施证券分析（三）构思证券组合资产（四）修订证券组合资产结构（五）对证券组合资产的经济效果进行评价 二、证券组合的管理（一）收入型证券组合（二）增长型证券组合（三）平衡型证券组合 第三节 现代证券组合管理 一、马柯威茨的均值方差模型（一）模型概述（二）有效边界（三）选择最佳的证券组合 1、无差异曲线 2、最优证券组合（四）马柯威茨均值方差模型的应用 二、资本资产定价模型（一）标准的资本资产定价模型 1、假设条件 2、资本市场线 3、证券市场线（二）特征线模型 1、 $\alpha$ 系数 2、证券特征线 3、投资分散化（三）资本资产定价模型的应用

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)