

证券业从业人员资格考试大纲-证券投资分析4 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_E4_B8_9A_E4_c33_41879.htm (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、 α 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 第八章 证券分析师的自律性组织和道德规范 第一节 证券分析师 一、证券分析师的定义 二、我国的证券分析师内涵 三、证券分析师的主要职能 第二节 国外证券分析师自律组织简介 一、亚洲的证券分析师组织 二、美加的证券分析师组织 三、欧洲的证券分析师组织 四、拉丁美洲的证券分析师组织 第三节 我国的证券分析师自律组织 一、建立我国的证券分析师自律组织的必要性 二、我国的证券分析师自律组织及其任务 第四节 证券分析师职业道德规范 一、证券分析师职业道德的十六字原则 二、证券分析师执业纪 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