证券投资分析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_E6_8A_95_E8_c33_41913.htm 本章要点：掌握证券组合管理的含义和基本类型；证券组合管理的目标和使用方法，以及5个基本的步骤；初步了解现代投资理论的起源和发展过程。了解对于风险和收益的度量方式，能够具体地计算证券组合的风险和收益；熟悉马可维茨模型的基本假设条件，以及其中所使用的可行域、有效边界和无差异曲线等概念；详细地知道马可维茨模型寻找最佳组合的每个具体步骤。了解CAPM模型的基本假设条件；了解无风险收益率和市场组合等相关概念；明确资本市场线和证券市场线的具体的表达式，以及表达式其中每个字母所代表的含义和含义；了解资本资产定价模型的两方面的应用；了解 β 系数和 α 系数含义和对指示作用；了解资本资产定价模型的有效性。了解市场有效性假设理论的起源和具体的叙述；了解对二类市场产生影响的信息的含义；一种有效市场的名称和划分区分方法，以及对信息的反应；了解有效市场与证券分析的关系 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