

证券业从业人员资格考试大纲21 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\\_41989.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/41/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E4_B8_9A_E4_c33_41989.htm) 第七章 证券组合管理理论 熟悉证券组合的含义、原因、类型、划分标准及其特点；熟悉证券组合管理的意义、特点、基本步骤；了解现代证券组合理论体系形成与发展进程；了解马柯威茨、夏普、罗斯对现代证券组合理论的主要贡献。掌握单一证券和证券组合期望收益率、方差的计算以及相关系数的意义。熟悉证券组合可行域和有效边界的含义；了解证券组合可行域和有效边界的一般图形；掌握有效证券组合的含义和特征；掌握证券投资比重和相关系数变动对证券组合收益水平和风险水平的影响；熟悉投资者偏好特征；掌握无差异曲线的含义、作用和特征；熟悉最优证券组合的含义；掌握最优证券组合的选择原理。了解资本资产定价模型的假设条件；了解无风险证券的含义；掌握最优风险证券组合与市场组合的含义及两者的关系；掌握资本市场线和证券市场线的定义、图形及其经济意义；掌握证券 $\beta$ 系数的定义和经济意义；了解资本资产定价模型的应用效果。熟悉证券组合业绩评估原则，了解业绩评估应注意的事项。熟悉詹森指数、特雷诺指数、夏普指数的定义、作用以及应用。第八章 证券分析师的自律性组织和执业规范 了解证券分析师的含义、职能和业务范围；掌握财务顾问业务和独立财务顾问的含义；了解财务顾问业务的准入及法规。熟悉证券分析师自律组织的性质、会员组成及主要功能；了解国际注册投资分析师协会、亚洲证券分析师联合会等国外主要证券分析师自律组织的状况。熟悉国际注

册投资分析师水平考试（CIIA?考试）的特点、基本规则与推广情况。了解证券分析师与律师、会计师在业务上的区别；了解建立我国证券分析师自律组织的必要性；掌握《中国证券分析师职业道德守则》的原则与含义；熟悉证券分析师执业纪律。掌握我国涉及证券投资咨询业务的现行法律法规；了解《证券、期货投资咨询管理暂行办法》和《关于规范面向公众开展的证券投资咨询业务行为若干问题的通知》的主要内容；了解诚信原则、隔离制度、民事责任规定的适用场合；掌握执业回避的适用场合及其具体情形；掌握执业披露的具体内容。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)