

证券业从业人员资格考试大纲26 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/42/2021\\_2022\\_\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_88\\_B8\\_E4\\_B8\\_9A\\_E4\\_c33\\_42003.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/42/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E4_B8_9A_E4_c33_42003.htm) 第十章 证券投资基金监管体系 熟悉证券投资基金监管的目标、原则和手段以及监管机构对设立基金申请的核准程序、监管方式和监管内容；了解基金自律性管理的组织机构以及监管的方式与内容；熟悉证券交易所对基金上市和基金投资的管理。了解基金管理公司涉及的审批事项和日常监管内容；掌握证券投资基金的设立审批原则；熟悉证券投资基金销售监管的内容；了解证券投资基金信息披露的原则；熟悉对证券投资基金投资与交易行为日常监管的内容。了解基金高管人员资格管理的重要性；熟悉我国基金高管人员的资格审批与日常监管；熟悉商业银行、证券公司及其他从事基金代销业务机构的资格审批；了解基金代销机构、注册登记机构的日常监督。了解担任基金托管人的审批程序和日常监管内容。第十一章 投资组合管理基础 了解证券组合管理的概念；熟悉现代投资理论的产生与发展。了解证券投资组合理论的基本假设和应用；熟悉单个证券和证券组合的收益与风险衡量方法；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。了解资本资产定价模型的含义、基本假设和应用；熟悉资本资产定价模型的推导。了解套利定价模型的含义、基本假设、应用和局限性；了解多因素模型、套利行为与套利组合；熟悉套利定价模型的推导。了解有效市场的基本概念、形式以及运用；了解行为金融理论的背景、理论模型及其运用。 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)