

证券业从业人员资格考试大纲27 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_42010.htm 第十二章 资产配置管理

熟悉资产配置的含义和主要考虑因素；了解资产配置管理的原因及目标；熟悉资产配置的基础步骤和动态的资产配置过程。了解资产配置的基本方法；熟悉历史数据法和情景综合分析法的主要特点及其在资产配置过程中的运用；熟悉有效市场前沿的确定过程和方法。了解资产配置的主要分类方法和类型；熟悉各类资产配置策略的一般特征以及在资产配置中的具体运用；熟悉战术性资产配置与战略性配置之间的异同。

第十三章 股票投资组合管理 了解股票投资组合的目的；熟悉股票投资组合管理基本策略；熟悉股票投资风格分类体系、股票投资风格指数及股票风格管理策略。了解积极型股票投资策略的分析基础；了解技术分析的基本理论；了解基本分析的主要指标和理论模型；熟悉技术分析和基本分析的主要区别。了解消极型股票投资的策略；熟悉指数化投资的理论和实践基础、构造组合与监控跟踪误差的程序。

第十四章 债券投资组合管理 了解单一债券收益率的衡量方法；熟悉债券投资组合收益率的衡量方法；了解影响债券收益率的因素；了解收益率曲线的概念；熟悉几种主要的期限结构理论。了解债券风险种类；熟悉测算债券价格波动性的方法；熟悉债券流通性价值的计算方法。了解积极债券组合管理和消极债券组合管理的理论基础和各种策略。

第十五章 基金绩效衡量 了解基金绩效衡量的目的与意义；熟悉衡量基金绩效需要考虑的因素；熟悉基金净值收益率的几种计算方法；了解

基金业绩衡量风险调整的必要性；熟悉风险调整衡量的方法；了解择时能力衡量的方法；熟悉绩效贡献的分析方法。

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