

投资指导：第七章证券组合管理考试大纲 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\\_\\_E6\\_8A\\_95\\_E8\\_B5\\_84\\_E6\\_8C\\_87\\_E5\\_c33\\_42686.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/42/2021_2022__E6_8A_95_E8_B5_84_E6_8C_87_E5_c33_42686.htm) 第一节 证券组合管理概述一、证券组合1.证券组合的含义2.构建证券组合的原因3.证券组合的分类二、证券组合管理1.主要内容2.研究方法（1）传统的证券组合管理（2）现代资产组合理论第二节 传统的证券组合管理一、传统的证券组合管理的基本步骤1.确定投资政策2.实施证券分析3.构思证券组合资产4.修订证券组合资产结构5.对证券组合资产的经济效果进行评价二、证券组合的管理1.收入证券组合2.增长证券组合3.收入增长证券组合第三节 现代证券组合理论一、现代证券组合理论的产生与发展1.现代证券组合理论的产生2.现代证券组合理论的发展二、马柯威茨的均值方差模型1.模型概述2.有效边界3.选择最佳的证券组合（1）无差异曲线（2）最优证券组合4.马柯威茨均值方差模型的应用三、资本资产定价模型1.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2.特征线模型（1） $\beta$ 系数（2）证券特征线（3）投资分散化3.资本资产定价模型的应用四、资本资产套利模型1.因素模型（1）单因素模型（2）多因素模型2.资本资产套价模型（1）资本资产套价理论（2）资本资产套价方程3.资本资产套价模型的应用第四节 证券组合管理的应用\*一、债券资产组合管理1.被动的债券资产组合管理（1）持续期限（2）免疫资产管理2.主动的债券资产组合管理（1）水平分析（2）债券调换（3）应急免疫（4）骑乘收益率曲线3.债券资产组合效益的评价二、股票资产组合管理三、证券组合资产经营成果评价1.经营成

果的风险调整测量2.市场时机选择 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)