

第七章证券组合管理理论复习重点证券从业资格考试 PDF 转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/598/2021_2022__E7_AC_AC

[_E4_B8_83_E7_AB_A0_E8_c33_598110.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/598/2021_2022__E7_AC_AC_E4_B8_83_E7_AB_A0_E8_c33_598110.htm) 熟悉证券组合的含义、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；熟悉现代证券组合理论体系形成与发展进程；熟悉马柯威茨、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；熟悉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；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。百考试题整理 熟悉资本资产定价模型的假设条件；熟悉无风险证券的含义；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 β 系数的定义和经济意义；熟悉资本资产定价模型的应用效果；熟悉套利定价理论的基本原理，掌握套利组合的概念及计算，能够运用套利定价方程计算证券的期望收益率，熟悉套利定价模型的应用。熟悉证券组合业绩评估原则，熟悉业绩评估应注意的问题；熟悉詹森指数、特雷诺指数、夏普指数的定义、作用以及应用。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