

2009年下半年证券从业资格考试：证券投资基金考试大纲
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_ti2020/616/2021_2022_2009_E5_B9_B4_E4_B8_8B_c33_616791.htm 第五部分 证券投资基金 目的与要求本部分内容包括证券投资基金的概念与特点，证券投资基金的法律形式与运作方式，证券投资基金业在国内外的发
展概况及其在金融体系中的地位与作用；证券投资基金的类型，主要基金类型的风险收益特征与分析方法；基金的募集、交易与注册登记；基金管理公司、基金托管人的主要职责、内部管理与内部控制；基金的市场营销；基金的估值、费用与会计核算；基金的收益分配与税收；基金的信息披露；基金的监管等知识。本部分的内容还包括投资组合理论及其运用、资产配置管理、股票与债券的投资组合管理以及基金绩效衡量等投资学方面的内容。通过本部分的学习，要求熟练掌握有关证券投资基金的基本理论、运作实务以及与基金投资管理有关的投资学方面的知识，熟悉有关法律法规、自律规范的基本要求。

第一章 证券投资基金概述掌握证券投资基金的概念与特点；熟悉证券投资基金与股票、债券、银行储蓄存款的区别；了解证券投资基金市场的运作与参与主体。掌握契约型基金与公司型基金的概念与区别；了解证券投资基金的起源与发展；了解我国证券投资基金业的发展概况。掌握封闭式基金与开放式基金的概念与区别。了解基金业在金融体系中的地位与作用。

第二章 基金的类型了解证券投资基金分类的意义，掌握各类基金的基本特征及其区别。了解股票基金在投资组合中的作用，掌握股票基金与股票的区

别，熟悉股票基金的分类，了解股票基金的投资风险，掌握股票基金的分析方法。了解债券基金在投资组合中的作用，掌握债券基金与债券的区别，熟悉债券基金的类型，了解债券基金的投资风险，掌握债券基金的分析方法。了解货币市场基金在投资组合中的作用，了解货币市场工具与货币市场基金的投资对象，了解货币市场基金的投资风险，掌握货币市场基金的分析方法。了解混合基金在投资组合中的作用，了解混合基金的类型，了解混合基金的投资风险。了解保本基金的特点，掌握保本基金的保本策略，了解保本基金的类型，了解保本基金的投资风险，掌握保本基金的分析方法。掌握ETF的特点、套利原理，了解ETF的类型，了解ETF的投资风险及其分析方法。了解QDII基金在投资组合中的作用，了解QDII的投资对象，了解QDII基金的投资风险。

第三章 基金的募集、交易与登记

了解封闭式基金的募集程序，熟悉封闭式基金合同生效的条件；掌握封闭式基金上市交易条件、交易账户的开立、交易规则，熟悉封闭式基金的交易费用，掌握封闭式基金折（溢）价率的计算。了解开放式基金的募集程序，熟悉开放式基金的基金合同生效的条件；熟悉开放式基金的认购渠道、步骤和收费模式，掌握基金认购份额的计算。掌握开放式基金申购、赎回的概念，熟悉开放式基金申购、赎回的时间，掌握开放式基金申购、赎回的原则，掌握申购份额、赎回金额的计算方法。了解巨额赎回的认定与处理方式。掌握开放式基金份额的转换、非交易过户、转托管与冻结的概念。熟悉ETF份额的认购方式、份额折算的方法；掌握ETF份额的交易规则；掌握ETF份额的申购和赎回的原则；熟悉ETF份额申购、赎回的对价方式与内容。掌握上

市开放式基金场外募集与场内募集的概念，熟悉上市开放式基金份额的申购、赎回；掌握上市开放式基金份额转托管的概念。掌握开放式基金份额的登记的概念，了解开放式基金登记机构及其职责，熟悉基金登记的流程，了解基金份额申购（认购）、赎回资金清算流程。

第四章 基金管理人熟悉基金管理公司的市场准入规定，熟悉基金管理人的职责和作用，了解基金管理公司的主要业务，了解基金管理公司的业务特点。熟悉基金管理公司的组织架构与部门职责。了解基金管理公司的投资决策机构，熟悉投资决策委员会的主要职责；了解一般的投资决策程序；了解基金管理公司的投资研究、投资交易与投资风险控制工作；熟悉基金投资管理人员的监督管理；熟悉基金从业人员投资证券投资基金的监督管理。了解基金管理公司治理结构的总体要求，掌握基金管理公司治理结构的基本原则，了解独立董事制度和督察长制度。掌握基金管理公司内部控制的概
念；熟悉内部控制的目标、原则、基本要求以及主要内容。

第五章 基金托管人熟悉基金资产托管业务，熟悉基金托管人在基金运作中的作用，了解基金托管人的市场准入规定，掌握基金托管人的职责；了解基金托管业务流程。了解基金托管人的机构设置与技术系统。了解基金财产保管的基本要求，熟悉基金资产账户的种类，掌握基金财产保管的内容。了解基金在交易所市场、全国银行间市场和场外市场资金清算的基本流程。掌握基金会计复核的内容。了解基金托管人对基金管理人监督的主要内容，了解对基金投资运作监管结果的处理方式。熟悉基金托管人内部控制的目标、原则、基本要素以及主要内容。

第六章 基金的市场营销了解基金市场营销的含义与特征，掌握基金

市场营销的内容。了解基金产品的设计与定价。了解基金的销售渠道与促销手段，了解基金客户服务的方式。了解销售机构的准入条件，了解有关法规针对基金销售机构职责的规范。熟悉对基金销售人员行为的规范，熟悉对基金宣传推介材料和活动的规范，掌握对基金销售费用的规范，熟悉基金销售适用性的内容，了解基金投资者教育活动的意义。了解基金销售业务信息管理的内容。熟悉基金销售结构内部控制的概念、目标、原则与主要内容。

第七章 基金的估值、费用与会计核算

掌握基金资产估值的概念，了解基金资产估值的重要性，了解基金资产估值需考虑的因素，掌握我国基金资产估值的方法；掌握计算错误的处理及责任承担，了解暂停估值的情形。了解QDII基金资产的估值。掌握基金运作过程中的两类费用的区别，熟悉基金费用的种类，掌握各种费用的计提标准及计提方式。掌握基金会计核算的特点，了解基金会计核算的主要内容。了解基金财务会计报告分析的目的，熟悉基金财务会计报表分析的方法。

第八章 基金利润分配与税收

熟悉基金的利润来源，掌握本期利润、本期已实现收益、期末可供分配利润以及未分配利润等概念。熟悉基金利润分配对基金份额净值的影响，掌握封闭式基金、开放式基金、货币市场基金收益分配的有关规定。熟悉针对基金作为营业主体的税收规定，了解针对基金管理人和托管人的税收制度与规定，熟悉针对机构法人和个人投资者的税收规定。

第九章 基金的信息披露

了解基金信息披露的含义与作用，了解信息披露的实质性原则与形式性原则，熟悉对基金信息披露禁止行为的规范，了解基金信息披露的分类，了解可扩展商业报告语言在基金信息披露中的应用，了解我国基金信息

披露制度体系。熟悉基金管理人的信息披露义务，了解基金托管人、基金份额持有人的信息披露义务。了解基金合同、招募说明书的主要披露事项；掌握基金合同、招募说明书的重要信息；了解基金托管协议的主要内容。熟悉基金季度报告、半年度报告、年度报告的主要内容。掌握基金信息披露的重大性概念及其标准，熟悉需要进行临时信息披露的重大事件，了解基金澄清公告的披露。掌握货币市场基金收益公告披露的内容，熟悉净值偏离度信息披露的要求，了解货币市场基金、净值表现以及投资组合报告的主要披露项目。掌握QDII基金的信息披露的内容与要求。

第十章 基金监管了解基金监管的含义与作用，熟悉基金监管的目标，掌握基金监管的原则，了解我国基金行业监管的法规体系。熟悉基金监管机构对基金市场的监管，了解行业协会、证券交易所对基金行业的自律管理。掌握对基金管理公司市场准入监管与日常监管的内容；了解对基金托管银行的监管；掌握对基金代销机构的监管；了解对基金登记机构的监管。掌握基金募集申请核准的主要程序和内容；掌握基金销售活动监管的内容；熟悉基金信息披露监管的内容；掌握基金投资与交易行为监管的内容。了解加强对基金行业高级管理人员监管的重要性；了解基金行业高级管理人员的任职资格条件；掌握对基金行业高级管理人员的基本行为规范；了解对投资管理人员的基本行为规范；了解对基金管理公司督察长的监督管理。

第十一章 证券组合管理理论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

个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。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；掌握贝塔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。掌握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。

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；熟悉资产配置的基本步骤。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；熟悉战略性资产配置与战术性资产配置之间的异同。

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。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

悉指数型投资策略的理论和实践基础、跟踪误差的问题和加强指数法。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主要因素；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衡量。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多种策略。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。了解基金绩效收益率的衡量。熟悉风险调整绩效衡量的方法。了解择时能力衡量的方法。熟悉绩效贡献的分析方法。相关推荐：2009年证券从业考试新旧教材对比《证券交易》2009年证券从业考试新旧教材对比《证券投资分析》2009年证券从业考试新旧教材对比《证券发行与承销》2009年证券从业考试新旧教材对比《证券市场基础知识》2009年证券从业考试新旧教材对比《证券投资基金》更多资料：好资料快收藏，百考试题证券站 百考试题证券在线模拟系统，海量题库2009年证券从业考试远程辅导，热招中！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