

06年《财务管理》第五章重点导读 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/70/2021\\_2022\\_06\\_E5\\_B9\\_B4\\_E3\\_80\\_8A\\_E8\\_B4\\_c44\\_70265.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/70/2021_2022_06_E5_B9_B4_E3_80_8A_E8_B4_c44_70265.htm)

一、考试大纲(一)掌握投资的概念与动机(二)掌握企业投资的种类及各类投资的主要特征(三)掌握投资收益的类型和必要投资收益的计算公式(四)掌握由两项资产构成的投资组合的总风险的计算及评价；掌握投资组合的总风险的构成内容及其在风险分散中的变动规律(五)掌握投资组合的  $\beta$  系数的计算方法；掌握资本资产定价模型和投资组合风险收益率的计算(六)熟悉导致投资风险产生的原因(七)熟悉投资组合的  $\beta$  系数推算；熟悉投资组合的期望收益率计算方法；熟悉投资组合风险的分散化的意义及方法(八)熟悉资本资产定价模型及其意义(九)了解投机与投资的关系；了解投机的积极和消极作用(十)了解投资风险和投资组合的定义；了解协方差和相关系数在投资组合风险分析中的作用；了解多项资产构成的投资组合的风险的计算方法(十一)了解单项资产的  $\beta$  系数的意义(十二)了解资本资产定价模型的定义及其假定(十三)了解影响金融资产平均收益率的基本要素二、本章历年考点1、系统性风险（市场风险）（2003年单选题、2005年判断题）2、非系统性风险（2004年单选题）3、投资的分类（2005年单选题）4、期望投资收益率（2005年单选题）5、两项资产组成的投资组合收益率方差的计算（2005年单选题）6、投资风险产生的原因（2005年多选题）7、相关系数（2003年判断题）8、 $\beta$  系数的计算（2002年计算题、2005年计算题）9、风险收益率的计算（2002年计算题、2005年计算题）10、必要收益率的计算（2002年计算题

、 2005年计算题 ) 三、 重点导读第一节 投资的概念与种类一

、 投资的定义投资是指特定经济主体为了在未来可预见的时期内获得收益或使资金增值，在一定时机向一定领域的标的物投放足够数额的资金或实物等货币等价物的经济行为。从特定企业角度看，投资就是企业为获取收益而向一定对象投放资金的经济行为。投资的特点：目的性、时间性、收益性、风险性 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)