

图书基本信息

书名：<<2011-2012证券业从业资格考试辅导用书>>

13位ISBN编号：9787513610346

10位ISBN编号：7513610347

出版时间：2012-1

出版时间：中国经济

作者：北京增金思源投资顾问有限公司

页数：303

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

为帮助参加证券业从业资格考试的考生早日通过资格考试。

本书编委会在充分研究考情、考纲、统编教材、真题的基础上，集中高校相关教学人员、证券行业一线专业人士、高等院校在校研究生等对考试和实际操作有着切身经历和丰富体会的专家精心编写了“证券业从业资格考试辅导用书”，包括：《证券市场基础知识》《证券交易》《证券发行与承销》《证券投资分析》《证券投资基金》五个科目。

本书与同类辅导书籍相比具有如下特点：1.严格按考试大纲的体例编排，囊括考纲所有考点，严格遵循教材内容，帮助考生全面复习。

2.编委会根据历次考试每个考点的出题情况和考试概率，对考点逐一进行星级评定，五星级是最重要的内容，考到的概率最高；四星级其次，其余以此类推。

3.在每个考点之后，随即附上最近几次考试真题的随堂演练，以帮助考生体验真题考试状态，领会考试要求。

4.本书最后部分是专家提供的全真模拟试题，以供考生考前实战演习时使用；为帮助考生在复习中进一步提高学习效率，模拟题附有答案解析以及该题相关考点在统编教材中的具体页码数，以便于考生通过试题迅速回到统编教材，全面查缺补漏。

## 作者简介

本书编委会由高校相关教学人员、证券行业一线专业人士、高等院校在校研究生等对考试和实际操作有着切身经历和丰富体会的专家组成。

本书由中国人才研究会金融人才专业委员会组织编写。

书籍目录

第一部分 考点逐条精解与真题随堂演练

第一章 证券投资基金概述

- 考点1.1 掌握证券投资基金的概念与特点
- 考点1.2 熟悉证券投资基金与股票、债券、银行储蓄存款的区别
- 考点1.3 了解证券投资基金市场的运作与参与主体
- 考点1.4 掌握契约型基金与公司型基金的概念与区别
- 考点1.5 了解证券投资基金的起源与发展
- 考点1.6 了解我国证券投资基金业的发展概况
- 考点1.7 掌握封闭式基金与开放式基金的概念与区别
- 考点1.8 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

- 考点2.1 了解证券投资基金分类的意义
- 考点2.2 掌握各类基金的基本特征及其区别
- 考点2.3 了解股票基金在投资组合中的作用
- 考点2.4 掌握股票基金与股票的区别
- 考点2.5 熟悉股票基金的分类
- 考点2.6 了解股票基金的投资风险
- 考点2.7 掌握股票基金的分析方法
- 考点2.8 了解债券基金在投资组合中的作用
- 考点2.9 掌握债券基金与债券的区别
- 考点2.10 熟悉债券基金的类型
- 考点2.11 了解债券基金的投资风险
- 考点2.12 掌握债券基金的分析方法
- 考点2.13 了解货币市场基金在投资组合中的作用
- 考点2.14 了解货币市场工具与货币市场基金的投资对象
- 考点2.15 了解货币市场基金的投资风险
- 考点2.16 掌握货币市场基金的分析方法
- 考点2.17 了解混合基金在投资组合中的作用
- 考点2.18 了解混合基金的类型
- 考点2.19 了解混合基金的投资风险
- 考点2.20 了解保本基金的特点
- 考点2.21 掌握保本基金的保本策略
- 考点2.22 了解保本基金的类型
- 考点2.23 了解保本基金的投资风险
- 考点2.24 掌握保本基金的分析方法
- 考点2.25 掌握ETF的特点、套利原理
- 考点2.26 了解ETF的类型
- 考点2.27 了解ETF的投资风险及其分析方法
- 考点2.28 了解QDII基金在投资组合中的作用
- 考点2.29 了解QDII的投资对象
- 考点2.30 了解QDII基金的投资风险
- 考点2.31 了解分级基金、交易所联接基金的基本概念
- 考点2.32 了解基金评价的概念与目的
- 考点2.33 了解基金评价的三个角度
- 考点2.34 了解基金评级方法

<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

- 考点2.35 掌握基金评级的运用
- 考点2.36 掌握基金评级的局限性
- 考点2.37 掌握基金评价业务原则
- 考点2.38 掌握基金评价禁止性规定

第三章 基金的募集、交易与登记

- 考点3.1 了解基金的募集程序
- 考点3.2 熟悉基金合同生效的条件
- 考点3.3 掌握开放式基金的认购步骤、认购方式、收费模式
- 考点3.4 掌握开放式基金认购份额的计算
- 考点3.5 掌握封闭式基金的认购
- 考点3.6 ETF与LOF份额的认购, QDII基金份额的认购
- 考点3.7 了解封闭式基金上市交易条件、交易规则
- 考点3.8 熟悉封闭式基金的交易费用
- 考点3.9 掌握封闭式基金折(溢)价率的计算
- 考点3.10 了解开放式基金的募集程序
- 考点3.11 熟悉开放式基金的基金合同生效的条件
- 考点3.12 熟悉开放式基金的认购渠道和步骤
- 考点3.13 掌握开放式基金申购、赎回的概念
- 考点3.14 掌握开放式基金申购、赎回的原则
- 考点3.15 熟悉开放式基金申购、赎回的费用
- 考点3.16 掌握开放式基金申购份额、赎回金额的计算方法
- 考点3.17 了解开放式基金申购、赎回的登记与款项的支付
- 考点3.18 了解巨额赎回的认定与处理方式
- 考点3.19 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
- 考点3.20 熟悉ETF份额的变更登记、ETF份额的认购方式、ETF份额折算的方法
- 考点3.21 掌握ETF份额的交易规则
- 考点3.22 掌握ETF份额的申购和赎回的原则
- 考点3.23 熟悉ETF份额申购、赎回清单与内容
- 考点3.24 了解上市开放式基金上市的交易条件
- 考点3.25 掌握上市开放式基金的交易规则
- 考点3.26 了解上市开放式基金场外申购赎回与场内申购赎回的概念
- 考点3.27 掌握上市开放式基金份额转托管的概念
- 考点3.28 掌握QDII基金申购赎回与一般开放式基金申购赎回的区别
- 考点3.29 掌握开放式基金份额的登记的概念
- 考点3.30 了解开放式基金登记机构及其职责
- 考点3.31 熟悉基金登记的流程
- 考点3.32 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

- 考点4.1 熟悉基金管理公司的市场准入规定
- 考点4.2 熟悉基金管理人的职责和作用
- 考点4.3 了解基金管理公司的主要业务
- 考点4.4 了解基金管理公司的业务特点
- 考点4.5 熟悉基金管理公司的组织架构与部门职责
- 考点4.6 了解基金管理公司的投资决策机构
- 考点4.7 熟悉投资决策委员会的主要职责
- 考点4.8 了解一般的投资决策程序
- 考点4.9 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

<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

- 考点4.10 熟悉特定客户资产管理业务规范性要求
- 考点4.11 了解基金管理公司治理结构的总体要求
- 考点4.12 掌握基金管理公司治理结构的基本原则
- 考点4.13 了解独立董事制度和督察长制度
- 考点4.14 掌握基金管理公司内部控制的概  
念
- 考点4.15 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

- 考点5.1 熟悉基金资产托管业务
- 考点5.2 熟悉基金托管人在基金运作中的作用
- 考点5.3 了解基金托管人的市场准入规定
- 考点5.4 掌握基金托管人的职责
- 考点5.5 了解基金托管业务流程
- 考点5.6 了解基金托管人的机构设置与技术系统
- 考点5.7 了解基金财产保管的基本要求
- 考点5.8 熟悉基金资产账户的种类
- 考点5.9 掌握基金财产保管的内容
- 考点5.10 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
- 考点5.11 掌握基金会计复核的内容
- 考点5.12 了解基金托管人对基金管理人监督的主要内容
- 考点5.13 了解对基金投资运作监管结果的处理方式
- 考点5.14 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

- 考点6.1 了解基金市场营销的含义与特征
- 考点6.2 掌握基金市场营销的内容
- 考点6.3 了解基金产品的设计与定价
- 考点6.4 了解基金的销售渠道与促销手段
- 考点6.5 了解基金客户服务的方式
- 考点6.6 了解销售机构的准入条件
- 考点6.7 了解有关法规针对基金销售机构职责的规范
- 考点6.8 熟悉对基金销售人员行为的规范
- 考点6.9 熟悉对基金宣传推介材料和活动的规范
- 考点6.10 掌握对基金销售费用的规范
- 考点6.11 熟悉基金销售适用性的内容
- 考点6.12 熟悉反洗钱客户风险等级划分标准
- 考点6.13 了解基金投资者教育活动的意义
- 考点6.14 了解基金销售业务信息管理的内容
- 考点6.15 熟悉基金销售机构内部控制的概念、目标、原则与主要内容

第七章 基金的估值、费用与会计核算

- 考点7.1 掌握基金资产估值的概念
- 考点7.2 了解基金资产估值的重要性
- 考点7.3 了解基金资产估值需考虑的因素
- 考点7.4 掌握我国基金资产估值的方法
- 考点7.5 掌握计算错误的处理及责任承担
- 考点7.6 了解暂停估值的情形
- 考点7.7 了解QDII基金资产的估值
- 考点7.8 掌握基金运作过程中的两类费用的区别
- 考点7.9 熟悉基金费用的种类

<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

考点7.10 掌握各种费用的计提标准及计提方式

考点7.11 掌握基金会计核算的特点

考点7.12 了解基金会计核算的主要内容

考点7.13 了解基金财务会计报告分析的目的

考点7.14 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

考点8.1 熟悉基金的利润来源

考点8.2 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

考点8.3 熟悉基金利润分配对基金份额净值的影响

考点8.4 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

考点8.5 熟悉针对基金作为营业主体的税收规定

考点8.6 了解针对基金管理人和托管人的税收制度与规定

考点8.7 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

考点9.1 了解基金信息披露的含义与作用

考点9.2 了解信息披露的实质性原则与形式性原则

考点9.3 熟悉对基金信息披露禁止行为的规范

考点9.4 了解基金信息披露的分类

考点9.5 了解可扩展商业报告语言在基金信息披露中的应用

考点9.6 了解我国基金信息披露制度体系

考点9.7 熟悉基金管理人的信息披露义务

考点9.8 了解基金托管人、基金份额持有人的信息披露义务

考点9.9 了解基金合同、招募说明书的主要披露事项

考点9.10 掌握基金合同、招募说明书的重要信息

考点9.11 了解基金托管协议的主要内容

考点9.12 熟悉基金季度报告、半年度报告、年度报告的主要内容

考点9.13 掌握基金信息披露的重大性概念及其标准

考点9.14 熟悉需要进行临时信息披露的重大事件

考点9.15 了解基金澄清公告的披露

考点9.16 掌握货币市场基金收益公告披露的内容

考点9.17 熟悉净值偏离度信息披露的要求

考点9.18 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

考点9.19 掌握QDII基金的信息披露的内容与要求

考点9.20 掌握ETF的信息披露

第十章 基金监管

考点10.1 了解基金监管的含义与作用

考点10.2 熟悉基金监管的目标

考点10.3 掌握基金监管的原则

考点10.4 了解我国基金行业监管的法规体系

考点10.5 熟悉基金监管机构对基金市场的监管

考点10.6 了解行业协会、证券交易所对基金行业的自律管理

考点10.7 掌握对基金管理公司市场准入监管与日常监管的内容

考点10.8 了解对基金托管银行的监管

考点10.9 掌握对基金代销机构的监管

考点10.10 了解对基金登记机构(TA)的监管

考点10.11 掌握基金募集申请核准的主要程序和内容

考点10.12 掌握基金销售活动监管的内容

<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

- 考点10.13 熟悉基金信息披露监管的内容
- 考点10.14 掌握基金投资与交易行为监管的内容
- 考点10.15 了解加强对基金行业高级管理人员监管的重要性
- 考点10.16 了解基金行业高级管理人员的任职资格条件
- 考点10.17 掌握对基金行业高级管理人员的基本行为规范
- 考点10.18 掌握对投资管理人的基本行为规范
- 考点10.19 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

- 考点11.1 熟悉证券组合的含义、类型、划分标准及其特点
- 考点11.2 熟悉证券组合管理的意义、特点、基本步骤
- 考点11.3 熟悉现代证券组合理论体系形成与发展进程
- 考点11.4 熟悉马柯威茨、夏普、罗斯对现代证券组合理论的主要贡献
- 考点11.5 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
- 考点11.6 熟悉证券组合可行域和有效边界的含义
- 考点11.7 熟悉证券组合可行域和有效边界的一般图形
- 考点11.8 掌握有效证券组合的含义和特征
- 考点11.9 熟悉投资者偏好特征
- 考点11.10 掌握无差异曲线的含义、作用和特征
- 考点11.11 熟悉最优证券组合的含义
- 考点11.12 掌握最优证券组合的选择原理
- 考点11.13 熟悉资本资产定价模型的假设条件
- 考点11.14 熟悉无风险证券的含义
- 考点11.15 掌握最优风险证券组合与市场组合的含义及两者的关系
- 考点11.16 掌握资本市场线和证券市场线的定义、图形及其经济意义
- 考点11.17 掌握证券系数的定义和经济意义
- 考点11.18 熟悉资本资产定价模型的应用效果
- 考点11.19 熟悉套利定价理论的基本原理
- 考点11.20 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
- 考点11.21 熟悉套利定价模型的应用
- 考点11.22 掌握有效市场的基本概念、形式以及运用
- 考点11.23 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

- 考点12.1 熟悉资产配置的涵义和主要考虑因素
- 考点12.2 了解资产配置管理的原因及目标
- 考点12.3 熟悉资产配置的基本步骤
- 考点12.4 了解资产配置的基本方法
- 考点12.5 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
- 考点12.6 熟悉有效市场前沿的确定过程和方法
- 考点12.7 了解资产配置的主要分类方法和类型
- 考点12.8 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
- 考点12.9 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

- 考点13.1 了解股票投资组合的目的
- 考点13.2 熟悉股票投资组合管理基本策略
- 考点13.3 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
- 考点13.4 了解积极型股票投资策略的分析基础
- 考点13.5 了解技术分析的基本理论



<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

- 考点13.6 了解基本分析的主要指标和理论模型
- 考点13.7 熟悉技术分析和基本分析的主要区别
- 考点13.8 了解消极型股票投资的策略
- 考点13.9 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

- 考点14.1 了解单一债券收益率的衡量方法
- 考点14.2 熟悉债券投资组合收益率的衡量方法
- 考点14.3 了解影响债券收益率的主要因素
- 考点14.4 了解收益率曲线的概念
- 考点14.5 熟悉几种主要的期限结构理论
- 考点14.6 了解债券风险种类
- 考点14.7 熟悉测算债券价格波动性的方法
- 考点14.8 熟悉债券流通性价值的衡量
- 考点14.9 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 基金绩效衡量与评价

- 考点15.1 了解基金绩效衡量的目的与意义
- 考点15.2 熟悉衡量基金绩效需要考虑的因素
- 考点15.3 掌握绩效衡量问题的不同视角
- 考点15.4 熟悉基金净值收益率的几种计算方法
- 考点15.5 了解基金绩效收益率的衡量方法
- 考点15.6 熟悉风险调整绩效衡量的方法
- 考点15.7 了解择时能力衡量的方法
- 考点15.8 熟悉绩效贡献的分析方法

第二部分 全真模拟试题

全真模拟题（一）

全真模拟题（二）

第三部分 全真模拟试题答案、考点解析与教材链接

全真模拟题（一）答案、考点解析与教材链接

全真模拟题（二）答案、考点解析与教材链接

章节摘录

(一) 资本市场线 投资者依照马柯威茨理论构建最优证券组合, 由无风险证券F出发并与原有风险证券组合可行域的有效边界相切的射线FT, 就是在现有假设条件下所有证券组合形成的可行域的有效边界。

有效边界FT上的切点证券组合T具有三个重要的特征: 其一, T是有效组合中唯一一个不含无风险证券而仅由风险证券构成的组合; 其二, 有效边界FT上的任意证券组合, 即有效组合, 均可视为无风险证券F与T的再组合; 其三, 切点证券组合T完全由市场确定, 与投资者的偏好无关。

切点证券组合具有如下经济意义: 1. 所有投资者拥有同一个证券组合可行域和有效边界。

2. 每个投资者按照各自的偏好购买各种证券, 其最终结果是每个投资者手中持有的全部风险证券所形成的风险证券组合在结构上恰好与切点证券组合T相同。

3. 当市场处于均衡状态时, 最优风险证券组合T就等于市场组合。

市场组合是指由风险证券构成, 并且其成员证券的投资比例与整个市场上风险证券的相对市值比例一致的证券组合。

在资本资产定价模型假设下, 当市场达到均衡时, 市场组合M成为一个有效组合; 所有有效组合都可视为无风险证券F与市场组合M的再组合。

在均值标准差平面上, 所有有效组合刚好构成连接无风险资产F与市场组合M的射线FM称为资本市场线。

.....

编辑推荐

《证券业从业资格考试辅导用书：证券投资基金（2011-2012）》根据2011年证券业从资格考试大纲和统编教材编写。

严格遵循考纲，浓缩教材内容      考点逐条精解，附全真模拟题      考点精解配有真题随堂演练，即时强化学习效果。

答案解析同步链接教材，节省复习时间      对真题进行数量分析，推导命题规律，锁定考点。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>