

第三章 证券资产管理

证券资产管理概述

- 基金管理公司的资产管理
 - 证券投资基金的种类
 - 证券投资基金的当事人
 - 证券投资基金的投资管理
- 证券公司的资产管理
 - 集合资产管理业务
 - 定向资产管理业务
 - 专项资产管理业务
- 资管新规的影响

投资组合的基本理论

- 证券组合的含义与类型
- 证券组合收益与风险的度量
- 证券组合的可行性
- 有效证券组合与有效边界
- 资本市场线与证券市场线

证券投资基金组合管理

- 证券投资基金组合的类型
- 证券投资基金组合的特点
- 证券组合管理的基本步骤
- 构建投资组合需要考虑的主要因素

期权

- 期权概述
- 期权的分类
 - 看涨期权
 - 看跌期权
- 期权到期日价值与净损益
 - 买入看涨期权
 - 卖出看涨期权
 - 买入看跌期权
 - 卖出看跌期权
- 期权组合投资策略
 - 保护性看跌期权
 - 抛补看涨期权
 - 跨式期权
- 期权价格的影响因素
 - 标的资产的市场价格
 - 期权的执行价格
 - 期权的有效期
 - 标的资产价格的波动率
 - 无风险利率
 - 股息支付
- 布莱克-斯科尔斯期权定价公式

投资组合的业绩评价

- 詹森指数
- 特雷诺指数
- 夏普指数