

# 《资本市场导论》

## 图书基本信息

书名：《资本市场导论》

13位ISBN编号：9787801186676

10位ISBN编号：7801186672

出版时间：1998-06

出版社：经济管理出版社

页数：746

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

## 书籍目录

### 目录

#### 第一篇 国民经济运行中的资本市场

##### 第一章 储蓄、投资与资本市场

###### 第一节 储蓄、投资与资本形成

###### 一、国民经济中的储蓄

###### 二、国民经济中的投资

###### 三、储蓄—投资转化机制

###### 第二节 资本市场概说

###### 一、概念界说

###### 二、资本市场中证券市场的作用

###### 三、资本市场中的直接融资和间接融资

###### 四、资本市场中的债券市场

###### 五、股票市场

###### 六、资本市场中的机构投资者

###### 本章小结

###### 思考题

#### 第二章 企业运行中的资本

##### 第一节 资本及其功能

###### 一、资本、负债和资产

###### 二、资本的主要特点

###### 三、资本的经济功能

##### 第二节 产权 企业法人产权与资本关系

###### 一、产权

###### 二、企业法人产权

###### 三、资本与企业法人产权

##### 第三节 资本与企业组织制度

###### 一、企业组织制度

###### 二、资本与现代企业制度

###### 三、资本制度与深化企业改革

##### 第四节 企业的资本充实原则与资本市场发展

###### 一、企业的资本充实性原则

###### 二、资本不足的经济后果

###### 三、发展资本市场 充实企业资本

###### 本章小结

###### 思考题

#### 第二篇 资本市场的工具和机构

#### 第三章 股票

##### 第一节 股票和股票价值

###### 一、股票及其特点

###### 二、股票价值

###### 三、股份变动

##### 第二节 股东权利和股票收益

###### 一、股东和股东权利

###### 二、股东会议

###### 三、股票收益

##### 第三节 普通股股票和优先股股票

###### 一、普通股股票

## 二、优先股股票

### 第四节 股票形式的发展

#### 一、认股权证

#### 二、存托凭证

#### 三、保本股票

#### 四、附有认股权的股票

#### 五、欧洲股权

#### 本章小结

#### 思考题

## 第四章 债券

### 第一节 债券的特征与类型

#### 一、债券的基本特征

#### 二、债券的种类

### 第二节 国债和地方政府债券

#### 一、国债的特点和分类

#### 二、地方政府债券的特点

#### 三、地方政府债券的分类

#### 四、国债、地方政府债券的收益

#### 五、国债、地方政府债券的风险

### 第三节 公司债券

#### 一、公司债券的特点

#### 二、公司债券的种类

#### 三、公司债的收益与风险

### 第四节 可转换公司债券

#### 一、可转换公司债券的特点

#### 二、可转换债券的分类

#### 三、可转换债券的收益和风险

#### 本章小结

#### 思考题

## 第五章 投资基金和投资基金证券

### 第一节 投资基金概说

#### 一、投资基金的基本规定

#### 二、投资基金的类型

### 第二节 投资基金的运行机制

#### 一、投资基金的组织关系

#### 二、投资基金的资产关系

#### 三、投资基金的市场运作

### 第三节 基金证券的收益和风险

#### 一、投资基金证券的收益

#### 二、投资基金证券的风险

#### 本章小结

#### 思考题

## 第六章 资本市场的参与者

### 第一节 证券发行人

#### 一、发行人及其特点

#### 二、发行人资格

### 第二节 投资者

#### 一、投资者及其特点

#### 二、投资者分类

## 第三节 中介机构

- 一、中介机构的基本职能
- 二、证券经营机构
- 三、其他中介机构

## 第四节 市场组织以及管理监督机构

- 一、证券交易所
- 二、场外交易市场
- 三、监督管理机构和自律性组织

## 本章小结

## 思考题

## 第三篇 资本市场运行

## 第七章 股票市场

### 第一节 股票发行市场

- 一、股票发行和发行条件
- 二、股票发行价格
- 三、股票发行方式
- 四、股票承销方式
- 五、股票发行过程

### 第二节 股票交易市场

- 一、股票交易市场的功能
- 二、股票交易市场的类别
- 三、股票上市和上市条件
- 四、股票交易价格与除权价格
- 五、股票价格指数及其编制
- 六、世界主要价格指数
- 七、股票交易过程

## 本章小结

## 思考题

## 第八章 债券和基金证券市场

### 第一节 国债一级市场

- 一、国债的发行
- 二、发行程序和承销过程

### 第二节 公司债券和基金证券的一级市场

- 一、公司债的发行
- 二、基金证券的发行

### 第三节 债券和基金证券的二级市场

- 一、债券和基金证券的上市
- 二、现货交易
- 三、回购和逆回购交易
- 四、债券和基金证券的交易价格

## 本章小结

## 思考题

## 第九章 抵押贷款和资产证券市场

### 第一节 抵押贷款一级市场

- 一、抵押贷款一级市场的基本机制
- 二、固定利率抵押贷款
- 三、分级支付的抵押贷款
- 四、可调整利率抵押贷款

### 第二节 抵押贷款二级市场及抵押贷款证券化

一、抵押贷款二级市场的产生与发展

二、抵押贷款二级市场的交易工具

三、转手抵押贷款证券的运作技巧

第三节 资产证券化及资产证券市场

一、资产证券化的兴起与发展

二、资产证券化的特点与风险防范

三、资产证券化的效益

本章小结

思考题

第十章 企业购并市场

第一节 企业的收购和合并

一、企业购并的特点

二、公司购并的主要形式

三、公司反购并策略

第二节 公司购并的基本程序

一、公司收购的策划

二、公司收购的实施

三、公司合并的基本程序

第三节 公司购并价格的评估

一、公司购并价格的评估方法

二、公司收购的估价模型

三、公司商誉的估价方法

本章小结

思考题

第十一章 国际资本市场

第一节 国际资本市场概述

一、国际资本市场的形成与发展

二、国际资本市场的结构与功能

第二节 离岸金融市场

一、离岸金融市场的产生

二、伦敦型离岸金融中心

三、纽约型离岸金融中心

四、避税港型离岸金融中心

第三节 国际信贷市场

一、欧洲美元与国际信贷市场的形成

二、国际信贷市场中的独家银行贷款和

辛迪加贷款

三、国际信贷的二级市场

第四节 国际债券市场

一、国际债券市场类型

二、国际债券市场工具

第五节 国际股票市场

一、国际股票市场

二、国际股票发行程序

三、世界主要的股票市场

本章小结

思考题

第十二章 市场参与者的风险及其防范

第一节 资本市场的风险

- 一、资本市场风险的特点
- 二、引致风险的主要因素
- 三、资本市场的风险分析
- 第二节 资本市场的风险估算
  - 一、风险估算的前提条件
  - 二、投资风险估算
  - 三、运作风险估算
- 第三节 资本市场的风险防范
  - 一、风险防范的基本涵义和原则
  - 二、风险防范的主要机制
  - 三、机构运作中的风险管理
- 本章小结
- 思考题
- 第十三章 资本市场的监督管理
  - 第一节 资本市场的规范化
    - 一、资本市场规范化的内涵
    - 二、资本市场的“三公原则”
  - 第二节 资本市场的监督管理
    - 一、监管概说
    - 二、监管的体制模式
    - 三、监管方式
    - 四、监管手段
    - 五、对操纵市场行为的监管
    - 六、对内幕交易的监管
  - 第三节 信息的公开披露
    - 一、信息公开披露的涵义
    - 二、信息披露的监管
- 本章小结
- 思考题
- 第四篇 金融衍生产品市场
- 第十四章 金融衍生产品市场导论
  - 第一节 概说
    - 一、定义
    - 二、发展历史
  - 第二节 分类
    - 一、远期
    - 二、互换
    - 三、金融期货
    - 四、金融期权
  - 第三节 基本功能
  - 第四节 风险管理
- 本章小结
- 思考题
- 第十五章 金融期货市场
  - 第一节 期货市场概述
    - 一、性质及特点
    - 二、期货交易原理
    - 三、期货分类
  - 第二节 期货市场的运行

## 一 期货合约

### 二、交易保证金

### 三、期货交易的基本过程

### 四、期货交易的特点

## 第三节 期货市场投资

### 一、期货市场投资特点

### 二、套期图利

### 三、期货市场的投资效应

### 本章小结

### 思考题

## 第十六章 期权市场

### 第一节 期权的特点和基本原理

#### 一、期权的内涵和特点

#### 二、期权的主要分类

#### 三、期权的基本原理

### 第二节 期权市场运行

#### 一、期权合约

#### 二、期权交易的基本过程

#### 三、交易保证金

#### 四、期权交易特点

### 第三节 期权市场交易策略

#### 一、基础的交易策略和期权投资特点

#### 二、期权投资组合

### 本章小结

### 思考题

## 第五篇 资本市场理论

## 第十七章 金融资产及其价值

### 第一节 资产概说

#### 一、“资产”的涵义

#### 二、资产与财产

### 第二节 金融资产及其价值的衡量

#### 一、金融资产界说

#### 二、金融资产价值的衡量

### 本章小结

### 思考题

## 第十八章 信息经济学与资本市场

### 第一节 风险 信息与信息经济学

#### 一、博弈论、决策论 信息经济学

#### 二、不确定性及风险

#### 三、风险和信息的

### 第二节 资本市场中的信息成本

#### 一、资本市场信息的生产

#### 二、市场信息的质量评价

#### 三、金融信息生产专业化的意义

### 第三节 资本市场有效性假说

#### 一、有效性市场的条件

#### 二、有效市场的类型

### 本章小结

### 思考题

## 第十九章 现代公司资本结构理论

### 第一节 作为资本市场组成部分的公司资本结构理论

### 第二节 资本结构理论：MM定理

#### 一、MM定理I

#### 二、MM定理

### 第三节 资本结构理论的发展

#### 一、放松无税收假定

#### 二、放松企业无破产成本的假定与平衡理论

#### 三、其他资本结构理论

### 第四节 企业资本结构：对债券融资的考察

#### 一、成本分析

#### 二、杠杆效应

#### 三、税收分析

#### 本章小结

#### 思考题

## 第二十章 风险/收益与资本定价模型

### 第一节 总风险分析

### 第二节 资产组合理论

#### 一、资产组合和投资收益

#### 二、资产组合期望收益率

#### 三、资产组合的风险及风险度量

### 第三节 值和市场模型

#### 一、值和市场模型

#### 二、值的计算

### 第四节 资本资产定价模型（CAPM）

#### 一、资本资产定价模型

#### 二、资本资产定价模型的基本假定

#### 三、CAPM模型的验证

#### 四、多因素CAPM模型

#### 五、非理性（或多因素修正）资本资产定价模型（APT）

#### 六、APT的实用化模型

#### 本章小结

#### 思考题

## 第六篇 资本市场的投资运作

## 第二十一章 投资运作中的主体条件分析

### 第一节 投资偏好与投资收益目标

#### 一、投资运作

#### 二、投资偏好

#### 三、投资的收益目标

### 第二节 投资运作的主要原则

#### 一、一般原则

#### 二、买入运作的经验

#### 三、卖出运作的主要原则

### 第三节 投资运作中的选择

#### 一、投资运作的的能力

#### 二、投资运作的期限类型

#### 三、投资选择

#### 本章小结

#### 思考题



## 第二十二章 投资运作的基本分析

### 第一节 影响证券价格变动的因素

- 一、证券的理论价格与实际价格
- 二、影响证券价格变动的经济因素
- 三、影响证券价格变动的非经济因素

### 第二节 宏观经济分析

- 一、国内生产总值与国民收入
- 二、经济周期
- 三、通货膨胀
- 四、货币政策和财政政策

### 第三节 经济结构分析

- 一、经济结构与证券投资
- 二、产业部门结构分析
- 三、产业的地区结构

### 第四节 产业市场与产业分析

- 一、产业市场
- 二、产品生命周期与产业生命周期

本章小结

思考题

## 第二十三章 公司财务分析

### 第一节 公司财务分析的内涵

- 一、公司财务分析的主要目的
- 二、公司财务分析的主要对象
- 三、公司财务分析的主要指标

### 第二节 公司财务分析的基本程序和方法

- 一、公司财务分析的基本程序
- 二、公司财务分析的主要方法
- 三、财务分析的局限性

### 第三节 公司赋税

- 一、股份公司的税赋格局
- 二、公司的流转税
- 三、公司的所得税

本章小结

思考题

## 第二十四章 投资运作的技术分析

### 第一节 技术分析的前提条件

- 一、技术分析的若干假定前提
- 二、技术分析的局限性
- 三、技术分析的主要概念

### 第二节 K线图

- 一、K线基本含义
- 二、K线的典型性组合图形
- 三、K线的主要动态图形

### 第三节 移动平均线

- 一、移动平均线的计算
- 二、移动平均线的“八法则”

### 第四节 艾略特波浪理论

- 一、波浪理论的基本原理
- 二、波浪比率及实践操作

## 第五节 黄金分割律

- 一、黄金分割律的基本内涵
- 二、黄金分割律的运用

## 第六节 价量关系分析

- 一、价量关系分析的基本内容
- 二、价量关系组合表

本章小结

思考题

## 第二十五章 投资运作的技术指标和主要技巧

### 第一节 投资运作的主要技术指标

- 一、乖离率 (BIAS)
- 二、平滑异同移动平均线 (MACD)
- 三、相对强弱指标 (RSI)
- 四、威廉斯指标 (WMS%)
- 五、随机指标 (KD)
- 六、能量潮 (OBV)
- 七、心理线 (PSY)
- 八、腾落指标 (ADL)
- 九、涨跌比率 (ADR)
- 十、超买超卖指标 (OBOS)
- 十一、TAPI指标
- 十二、人气指标 (AR)
- 十三、买卖意愿指标 (BR)

### 第二节 主要投资技巧

- 一、顺势投资法
- 二、分次投资法
- 三、摊平投资法
- 四、拨档投资法
- 五、“入套”投资法
- 六、“踏空”投资法

本章小结

思考题

# 《资本市场导论》

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)