

《证券投资基金基础知识：考点精讲与》

图书基本信息

书名：《证券投资基金基础知识：考点精讲与实战演练》

13位ISBN编号：9787121280531

出版时间：2016-4

作者：基金从业资格考试命题研究中心

页数：256

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

《证券投资基金基础知识：考点精讲与》

内容概要

《证券投资基金基础知识：考点精讲与实战演练》是专为参加“基金从业资格考试”的人士编写的一本应试辅导书，严格按照最新考试大纲和指定教材编写。

在《证券投资基金基础知识：考点精讲与实战演练》的编写上，突出了权威性、实用性和及时性。所谓权威性，就是依据指定教材，归纳整理考试要点，旨在帮助考生迅速全面掌握考试内容；所谓实用性，就是将历次考试真题穿插于讲义、本章同步训练题之中，旨在帮助考生巩固所学知识，凸显考试要点；所谓及时性，就是本书的所有练习题都是依据考试真题的特点、难度及形式编写，旨在帮助考生提升应试能力。

《证券投资基金基础知识：考点精讲与实战演练》作为一本正式出版的“基金从业资格考试”应试辅导，内容新颖、形式活泼、功能实用，是帮助广大读者轻松通过考试的必备教材。

书籍目录

第1章 投资管理基础

1

1.1 财务报表

1

考点1 资产负债表、利润表和现金流量表所提供的信息

1

考点2 资产、负债和权益

4

考点3 利润和净现金流量

6

1.2 财务报表分析

7

考点4 流动性比率、财务杠杆比率、营运效率比率

8

考点5 杜邦分析法

11

1.3 货币的时间价值与利率

12

考点6 货币的时间价值的概念

12

考点7 即期利率和远期利率的概念

12

考点8 名义利率和实际利率的概念

14

考点9 单利和复利的概念

14

1.4 常用描述性统计概念

15

考点10 平均值、中位数、分位数的概念、计算和应用

15

考点11 方差和标准差的概念、计算和应用

16

考点12 正态分布的特征

17

考点13 相关性的概念

17

本章强化训练

18

答案与解析

20

第2章 权益投资

22

2.1 资本结构

22

考点1 不同资本类别之间投票权和所有权的区别

22

2.2 权益证券

25

考点2 权益证券的类型和特点

25

考点3 普通股和优先股的区别

25

考点4 存托凭证

25

考点5 可转债的定义、特征和基本要素

27

考点6 权证的定义和基本要素

28

考点7 不同种类权益资产的风险收益特征

30

考点8 影响公司在外发行股本的行为

31

2.3 股票分析方法

33

考点9 股票基本面分析和技术分析的区别

34

2.4 股票估值方法

40

考点10 内在价值法与相对估值法的区别

40

案例：安然公司的常规估值与EVA的背离

42

本章强化训练

45

答案与解析

46

第3章 固定收益投资

49

3.1 债券与债券市场

49

考点1 债券市场各参与方的责任以及发行人类型

49

考点2 债券的种类和特点

50

考点3 债券违约时的受偿顺序

53

考点4 投资债券的风险

54

考点5 中国两大债券交易市场

56

3.2 债券价值分析

57

考点6 债券的估值方法

57

考点7 债券价格和到期收益率的关系

58

考点8 利率的期限结构和信用利差

59

考点9 债券久期（麦考利久期和修正久期）的计算方法和应用

60

3.3 货币市场工具

61

考点10 货币市场工具的特点

61

考点11 常用货币市场工具类型

62

本章强化训练

70

答案与解析

71

第4章 衍生工具

73

4.1 衍生工具概述

73

考点1 衍生品合约的概念和特点

73

4.2 远期合约和期货合约

75

考点2 期货和远期的定义与区别

75

考点3 期货和远期的市场作用

77

4.3 期权合约

78

考点4 期权合约和影响期权定价的因子

78

4.4 互换合约

80

考点5 互换合约的概念

80

考点6 影响互换合约定价的因子

81

考点7 远期、期货、期权和互换的区别

83

本章强化训练

84

答案与解析

85

第5章 另类投资

87

5.1 另类投资概述

87

考点1 另类投资的优点和局限

87

考点2 另类投资的投资对象

89

5.2 私募股权投资

91

考点3 私募股权投资概述

91

考点4 私募股权投资的战略形式

91

考点5 私募股权投资基金的组织结构

94

考点6 私募股权投资的退出机制

96

5.3 不动产投资

97

考点7 不动产投资的定义

97

考点8 不动产投资的特点

97

考点9 不动产投资的类型

98

考点10 不动产投资工具

99

考点11 房地产投资信托基金的特点

100

5.4 大宗商品投资

102

考点12 大宗商品投资概述

102

考点13 大宗商品投资的类型

102

考点14 大宗商品的投资方式

103

本章强化训练

104

答案与解析

106

第6章 投资者需求

108

6.1 投资者类型和特征

108

考点1 投资者的主要类型、区分方法和特征

108

6.2 投资者需求和投资政策

111

考点2 不同类型投资者在资产配置上的需求和差异

111

考点3 投资政策说明书包含的主要内容

114

本章强化训练

114

答案与解析

115

第7章 投资组合管理

117

7.1 系统性风险、非系统性风险和风险分散化

117

考点1 系统性风险和非系统性风险的概念和来源

117

考点2 风险和收益的对应关系

118

7.2 资产配置

119

考点3 不同资产间的相关性及其对风险和收益的影响

119

考点4 均值方差法及其条件

120

考点5 最小方差法及有效性前沿、资本市场线

121

7.3 被动投资和主动投资

121

考点6 市场有效性的三个层次

121

考点7 主动投资和被动投资的概念、方法和区别

123

考点8 市场上主要的指数（股票和债券）的编制方法

124

考点9 量化投资和多因子模型

126

7.4 投资组合构建

127

考点10 股票投资组合的构建要点

127

考点11 债券投资组合的构建要点

128

7.5 投资管理部门

129

考点12 基金公司投资管理部门设置

129

本章强化训练

130

答案与解析

132

第8章 投资交易管理

135

8.1 证券市场的交易机制

135

考点1 指令驱动市场、报价驱动市场和经纪人市场三种市场

135

考点2 做市商和经纪人的区别

139

考点3 买空、卖空和加杠杆对风险和收益的影响

139

8.2 交易执行

142

考点4 基金公司投资交易流程

142

考点5 算法交易的概念和常见策略

143

考点6 交易成本与执行缺口

144

本章强化训练

146

答案与解析

148

第9章 投资风险的管理与控制

149

9.1 投资风险的类型

149

考点1 风险的定义和分类

149

9.2 投资风险的测量

150

考点2 风险敞口与风险敏感度的概念

150

9.3 不同类型基金的风险管理

151

考点3 股票基金的风险管理

151

考点4 债券型基金的风险管理

152

本章强化训练

154

答案与解析

155

第10章 基金业绩评价

157

10.1 基金业绩评价概述

157

考点1 投资业绩评价的基础概念

157

10.2 绝对收益与相对收益

157

考点2 绝对收益

158

考点3 收益率的计算方法

158

考点4 业绩比较基准概念与选取方法绝对收益与相对收益的概念

159

考点5 风险调整后收益的主要指标

159

10.3 业绩归因

161

考点6 Brinson归因方法的三个归因项

161

10.4 基金业绩评价方法

162

考点7 基金评价中的基金分类、业绩计算和风格类型

162

考点8 全球投资业绩标准（GIPS）的目的、作用和要求

164

本章强化训练

165

答案与解析

166

第11章 基金的投资交易与清算

169

11.1 基金参与证券交易所二级市场的交易与清算

169

考点1 证券投资基金场内证券交易市场

169

考点2 证券投资基金场内证券结算机构

169

考点3 证券投资基金场内交易涉及的主要费用项目及收费标准

170

考点4 场内证券交易特别规定及事项

176

考点5 场内证券交易清算与交收的原则

178

考点6 场内证券交易交收与资金清算的内容与模式

180

11.2 银行间债券市场的交易与结算

181

考点7 银行间债券市场的发展与现状

181

考点8 银行间债券市场的交易制度

183

考点9 银行间市场的交易品种和类型

183

考点10 银行间债券结算类型和方式

185

考点11 银行间债券结算业务类型

188

11.3 海外证券市场投资的交易与结算

191

考点12 境外市场交易与结算规则

191

考点13 QDII开展境外投资业务的交易与结算情况

193

本章强化训练

195

答案与解析

196

第12章 基金估值、费用与会计核算

198

12.1 基金资产估值

198

考点1 基金资产估值的概念

198

考点2 基金资产估值的法律依据

199

考点3 基金资产估值的重要性的和需要考虑的因素

199

考点4 基金资产估值的责任人

201

考点5 基金资产估值的估值程序及基本原则

201

考点6 具体投资品种的估值方法及基金暂停估值的情形

202

考点7 QDII基金资产估值的特殊规定

204

12.2 基金费用

205

考点8 基金费用的种类

205

考点9 基金管理费、托管费及销售服务费的计提标准及计提方式

205

考点10 不列入基金费用的项目种类

207

12.3 基金会计核算

207

考点11 基金会计核算的特点及主要内容

207

12.4 基金财务会计报告分析

210

考点12 基金财务报告分析的主要内容

210

本章强化训练

212

答案与解析

213

第13章 基金的利润分配与税收

216

13.1 基金利润及利润分配

216

考点1 基金利润来源及相关财务指标的主要内容

216

考点2 利润分配对基金份额净值的影响

218

考点3 基金分红的不同方式和货币市场基金利润分配的特殊规定

218

13.2 基金税收

220

考点4 基金投资活动中涉及的税收项目

220

考点5 投资者投资基金涉及的税收项目

221

本章强化训练

222

答案与解析

223

第14章 基金国际化的发展概况

225

14.1 海外市场发展

225

考点1 投资基金国际化投资概况

225

考点2 海外市场的监管情况

226

14.2 中国基金国际化发展

233

考点3 QFII、RQFII的概念、规则和发展概况

234

考点4 QDII的概念、规则和发展概况

237

考点5 基金互认的现状

242

考点6 沪港通的重要意义

243

本章强化训练

244

答案与解析

245

《证券投资基金基础知识：考点精讲与》

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