

《证券投资分析》

图书基本信息

书名：《证券投资分析》

13位ISBN编号：9787300025261

10位ISBN编号：7300025269

出版时间：1996-08

出版社：中国人民大学出版社

作者：吴晓求 编

页数：565

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

书籍目录

目录

第一篇 证券投资分析基础

第一章 证券投资分析概论

第一节 证券投资分析概述

一、什么是证券投资分析

二、证券投资分析的意义

三、证券投资分析的信息来源

四、证券投资分析的主要步骤

第二节 证券投资分析的主要方法

一、基本分析法

二、技术分析法

三、证券投资分析中易出现的失误

第二章 有价证券的价格决定

第一节 债券的价格决定

一、债券的定价原理

二、收益率曲线与利率的期限结构

三、债券的基本价值评估

第二节 股票的价格决定

一、市盈率估价方法

二、贴现现金流模型

三、简单的股票内在价值的估计模型

第三节 投资基金的价格决定

一、开放式基金的价格决定

二、封闭式基金的价格决定

第四节 其他投资工具的价格决定

一、可转换证券

二、优先认股权

三、认股权证

第二篇 证券投资的基本面分析

第三章 证券投资的宏观经济分析

第一节 宏观经济分析

一、宏观经济分析的意义与方法

二、评价宏观经济形势的相关变量

第二节 宏观经济分析的主要内容

一、宏观经济运行分析

二、宏观经济政策分析

三、经济指标分析

第四章 行业分析与区域分析

第一节 行业分析

一、行业分析的定义

二、行业划分的方法

三、行业一般特征分析

四、影响行业兴衰的主要因素

五、行业投资的选择

第二节 区域分析

一、经济区域分析

二、区域的板块效应

第五章 公司分析

第一节 公司基本素质分析

- 一、公司竞争地位分析
- 二、公司盈利能力及增长性分析
- 三、公司经营管理能力分析

第二节 公司财务分析

- 一、财务报表的种类
- 二、财务报表分析的意义与方法
- 三、财务比率分析
- 四、财务分析中应注意的问题

第三篇 证券投资技术分析

第六章 证券投资技术分析概述

第一节 技术分析的理论基础

- 一、技术分析的涵义
 - 二、技术分析的三大假设
- ### 第二节 技术分析的要素：价、量、时、空

- 一、价和量是市场行为最基本的表现
- 二、成交量与价格趋势的关系

第三节 技术分析方法的分类和应用时应注意的问题

- 一、技术分析方法的分类
- 二、技术分析方法应用时应注意的问题

第四节 其他主要技术分析理论和方法简介

- 一、随机漫步理论
- 二、循环周期理论
- 三、道氏理论
- 四、波浪理论
- 五、相反理论

第七章 K线理论

第一节 K线的画法和主要形状

- 一、K线的画法
- 二、K线的主要形状

第二节 K线的组合应用

- 一、单独一根K线的应用
- 二、由两根K线的组合推测行情
- 三、由三根K线推测市场行情

第三节 应用K线组合应注意的问题

第八章 切线理论

第一节 趋势分析

- 一、趋势的定义
- 二、趋势的方向
- 三、趋势的类型

第二节 支撑线和压力线

- 一、支撑线和压力线的作用
- 二、支撑线和压力线的相互转化
- 三、支撑线和压力线的确认和修正

第三节 趋势线和轨道线

- 一、趋势线
- 二、轨道线

第四节 黄金分割线和百分比线

一、黄金分割线

二、百分比线

第五节 扇形原理、速度线和甘氏线

一、扇形原理

二、速度线

三、甘氏线

第六节 应用切线应注意的问题

第九章 形态理论

第一节 价格移动的规律和两种形态类型

一、价格移动规律

二、价格移动的两种形态类型

第二节 反转突破形态 头肩形、多重顶底形和圆弧形

一、双重顶和双重底

二、头肩顶和头肩底

三、三重顶底形态

四、圆弧形形态

第三节 三角形形态和矩形形态

一、三角形形态

二、矩形

第四节 喇叭形、菱形、旗形和楔形

一、喇叭形和菱形

二、旗形和楔形

第五节 应用形态应注意的问题

第十章 波浪理论

第一节 波浪理论的形成历史及其基本思想

一、波浪理论形成简史

二、波浪理论的基本思想

第二节 波浪理论的主要原理

一、波浪理论考虑的因素

二、波浪理论价格走势的基本形态结构

三、浪的合并和浪的细分：波浪的层次

四、弗波纳奇数列与波浪的数目

第三节 波浪理论的应用及其不足

一、波浪理论的实际应用

二、波浪理论的不足

第十一章 技术指标法和主要技术指标

第一节 技术指标法概述

一、技术指标法的定义

二、产生技术指标的方法

三、技术指标的应用法则

四、技术指标的本质

五、技术指标法同其他技术分析方法的关系

六、应用技术指标应注意的问题

第二节 移动平均线（MA）和平滑异同移动平均线（MACD）

一、移动平均线

二、平滑异同移动平均线

第三节 威廉指标和KDJ指标

一、威廉指标

二、KDJ 指标

第四节 相对强弱指标 (RSI)

- 一、RSI的计算公式
- 二、RSI的应用法则

第五节 乖离率 (BIAS) 和心理线 (PSY)

- 一、乖离率
- 二、心理线

第六节 人气指标 (AR)、买卖意愿指标 (BR) 和中间意愿指标 (CR)

- 一、构造AR, BR和CR的基本原理
- 二、AR指标
- 三、BR指标
- 四、CR指标
- 五、AR, BR和CR指标的缺陷

第七节 OBV和TAPI

- 一、OBV
- 二、TAPI

第八节 ADL ADR和OBOS

- 一、ADL
- 二、ADR
- 三、OBOS

第四篇 证券组合投资与风险管理

第十二章 证券组合管理

第一节 证券组合管理概述

- 一、证券组合
- 二、证券组合管理

第二节 传统的证券组合管理

- 一、传统证券组合管理的基本步骤
- 二、传统的证券组合管理

第三节 证券投资风险与现代证券组合理论的产生和发展

- 一、投资组合风险的来源
- 二、系统风险与非系统风险
- 三、风险的度量
- 四、现代证券组合理论的产生和发展

第四节 证券间的关联性

- 一、协方差与相关系数
- 二、关联程度及其涵义
- 三、样本协方差、样本相关系数及回归直线的估计

第五节 两种证券的投资组合

- 一、两种证券组合的收益与方差
- 二、两种证券的结合线

第六节 证券组合及其可行域

- 一、证券组合的期望收益率和方差
- 二、证券组合的可行域

第七节 马柯威茨均值方差模型

- 一、投资者的共同偏好
- 二、有效的证券组合
- 三、投资者个人偏好与无差异曲线
- 四、利用无差异曲线确定最佳证券组合
- 五、马柯威茨均值方差模型的应用

第八节 确定有效证券组合

- 一、允许卖空时寻求最小方差集合
- 二、不允许卖空时的最小方差集合

第九节 虚构无差异曲线法

- 一、基本问题的求解（允许卖空时的有效组合）
- 二、标准问题的求解

第十节 存在无风险证券时的有效组合

- 一、有效边缘、最优风险组合与分离定理
- 二、允许卖空时的最优风险组合的确定

第十一节 证券分析与市场效率

- 一、证券分析的内容
- 二、市场效率
- 三、现实市场中的低效率特征

第十三章 风险资产的定价与证券组合管理的应用

第一节 标准的资本资产定价模型

- 一、模型的基本假设
- 二、资本市场线
- 三、证券市场线

第二节 特征线模型

- 一、证券与证券市场组合的关联性
- 二、资本资产定价模型下的特征线
- 三、 β -系数
- 四、证券风险的分解与分散化的效用

第三节 β -系数与资本资产定价模型的应用

- 一、 β -系数的涵义
- 二、 β -系数的估计
- 三、 β -系数的应用
- 四、资本资产定价模型的应用

第四节 资本资产定价模型下的均衡价格

- 一、使市场证券组合成为最优风险组合
- 二、证券价格与资本市场线
- 三、借入和贷出
- 四、即期消费与将来消费
- 五、综述

第五节 因素模型

- 一、单因素模型
- 二、多因素模型

第六节 套利定价理论

- 一、套利定价理论概述
- 二、套利定价方程
- 三、套利定价模型的应用

第七节 债券资产组合管理

- 一、债券利率风险的衡量
- 二、被动债券组合的管理
- 三、主动债券组合的管理
- 四、债券资产组合效益评价

第八节 股票资产组合管理

- 一、制定投资政策
- 二、证券分析与股票资产组合的构造

三、组合的修正

第九节 证券组合资产经营成果评价

一、詹森指数

二、特雷诺指数

三、夏普指数

第十四章 利用衍生金融工具进行风险管理

第一节 期货合约概述

一、期货合约的基本概念

二、期货合约交易基本组织管理特点

三、几种主要金融期货合约简介

第二节 期货合约在风险管理中的应用

一、用期货合约进行套期保值

二、期货合约的其他作用

第三节 期权合约及其在风险管理中的应用

一、期权合约的概念

二、期权合约的主要类型

三、期权合约买卖双方的状况分析

四、期权合约交易的组织特征

五、主要金融期权合约简介

六、期权合约在风险管理中的应用

第四节 掉期合约及其在风险管理中的应用

一、掉期合约概述

二、几种主要的掉期合约

三、掉期在资产分配中的应用

四、掉期期权

第五篇 证券投资技巧与经验总结

第十五章 主要投资技巧与格言式经验

第一节 主要投资技巧

一、游击战术

二、消耗战术

三、小股轮涨

四、板块联想涨跌

五、投资三分法

六、投资金字塔

七、顺势投资法

八、投资趋势法

九、投资三角形

十、保本投资法

十一、买卖平均法

十二、匀低成本法

十三、三成涨跌法

十四、排列组合法

十五、人醉我醒法

十六、渔翁撒网法

十七、追涨杀跌法

十八、十成涨跌法

十九、轮换拔档法

二十、随机应变法

二十一、反向投资法

- 二十二、杠铃投资法
- 二十三、守株待兔法
- 二十四、回补投资法
- 二十五、分散投资法
- 二十六、“博傻主义”投资法
- 二十七人气投资法
- 二十八、未雨绸缪法
- 二十九、“孙子兵法”
- 第二节 投资格言与经验概括
 - 一、股市十忌
 - 二、股市十记
 - 三、经验概括
- 第二版后记

《证券投资分析》

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