

<<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

出版时间：中国人民大学出版社

作者：吴晓求 编

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>

## <<证券投资分析>>

### 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

## <<证券投资分析>>

- 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

## <<证券投资分析>>

### 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

## <<证券投资分析>>

### 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

## &lt;&lt;证券投资分析&gt;&gt;

- 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、 $\beta$ -系数
    - 四、证券风险的分解与分散化的效用
  - 第三节  $\beta$ -系数与资本资产定价模型的应用
    - 一、 $\beta$ -系数的涵义
    - 二、 $\beta$ -系数的估计
    - 三、 $\beta$ -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

## <<证券投资分析>>

- 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

<<证券投资分析>>

- 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



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>