

图书基本信息

书名：<<2011-2012证券业从业资格考试辅导用书>>

13位ISBN编号：9787513610353

10位ISBN编号：7513610355

出版时间：2012-1

出版时间：中国经济

作者：北京增金思源投资顾问有限公司

页数：327

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>

## 内容概要

为帮助参加证券业从业资格考试的考生早日通过资格考试。

本书编委会在充分研究考情、考纲、统编教材、真题的基础上，集中高校相关教学人员、证券行业一线专业人士、高等院校在校研究生等对考试和实际操作有着切身经历和丰富体会的专家精心编写了“证券业从业资格考试辅导用书”，包括：《证券市场基础知识》《证券交易》《证券发行与承销》《证券投资分析》《证券投资基金》五个科目。

本书与同类辅导书籍相比具有如下特点：1.严格按考试大纲的体例编排，囊括考纲所有考点，严格遵循教材内容，帮助考生全面复习。

2.编委会根据历次考试每个考点的出题情况和考试概率，对考点逐一进行星级评定，五星级是最重要的内容，考到的概率最高；四星级其次，其余以此类推。

3.在每个考点之后，随即附上最近几次考试真题的随堂演练，以帮助考生体验真题考试状态，领会考试要求。

4.本书最后部分是专家提供的全真模拟试题，以供考生考前实战演习时使用；为帮助考生在复习中进一步提高学习效率，模拟题附有答案解析以及该题相关考点在统编教材中的具体页码数，以便于考生通过试题迅速回到统编教材，全面查缺补漏。

## 作者简介

本书编委会由高校相关教学人员、证券行业一线专业人士、高等院校在校研究生等对考试和实际操作有着切身经历和丰富体会的专家组成。

本书由中国人才研究会金融人才专业委员会组织编写。

## 书籍目录

## 第一部分 考点逐条精华与真题随堂演练

## 第一章证券投资分析概述00

考点1.1掌握证券投资的含义及证券投资分析的目标 0

考点1.2熟悉证券投资分析理论发展史 0

考点1.3熟悉证券投资分析的基本要素 0

考点1.4熟悉我国证券市场现存的主要投资方法及策略 0

考点1.5掌握基本分析法、技术分析法、量化分析法的定义、理论基础和内容

考点1.6熟悉证券投资分析应注意的问题

考点1.7掌握证券投资分析的信息来源

## 第二章 有价证券的投资价值分析与估值方法0

考点2.1熟悉证券估值的含义

考点2.2熟悉虚拟资本及其价格运动形式

考点2.3掌握有价证券的市场价格、内在价值、公允价值和边际安全的含义及相互关系

考点2.4熟悉货币的时间价值、复利、现值和贴现的含义及其例证

考点2.5掌握现金流贴现和净现值的计算

考点2.6掌握绝对估值和相对估值方法并熟悉其模型常用指标和适用性

考点2.7熟悉资产价值

考点2.8熟悉衍生产品常用估值方法

考点2.9掌握债券估值的原理

考点2.10掌握债券现金流的确定因素

考点2.11掌握债券贴现率概念及其计算公式

考点2.12熟悉债券报价

考点2.13掌握不同类别债券累计利息的惯例计算和实际支付价格的计算

考点2.14熟悉债券估值模型

考点2.15掌握零息债券、付息债券、累息债券的定价计算

考点2.16掌握债券当期收益率、到期收益率、即期利率、持有期收益率、赎回收益率的计算

考点2.17熟悉利率的风险结构、收益率差、信用利差等概念

考点2.18熟悉利率的期限结构

考点2.19掌握收益率曲线的概念及其基本类型

考点2.20熟悉期限结构的影响因素及利率期限结构基本理论

考点2.21熟悉影响股票投资价值的内外部因素及其影响机制

考点2.22熟悉计算股票内在价值的不同股息增长率下的现金流贴现模型

考点2.23掌握计算股票内在价值的不同股息增长率下的现金流贴现模型公式及应用

考点2.24熟悉计算股票市场价格的市盈率估价方法及其应用缺陷

考点2.25熟悉市净率的基本概念及其在股票估值方面的运用

考点2.26熟悉金融期货合约的定义及其标的

考点2.26掌握金融期货理论价格的计算公式和影响因素(P53)

考点2.28熟悉金融期权的定义

考点2.29掌握期权的内在价值、时间价值及期权价格影响因素

考点2.30掌握可转换证券的定义

考点2.31熟悉可转换证券的投资价值、转换价值、理论价值和市场价值的含义及计算方法

考点2.32掌握可转换证券转换平价、转换升水、转换贴水的计算

考点2.33熟悉可转换证券转换升水比率、转换贴水比率的计算

考点2.34掌握权证的概念及分类

考点2.35熟悉权证的理论价值的含义、各变量变动对权证价值的影响以及权证理论价值的计算方

法

考点2.36掌握认股权证溢价计算公式

考点2.37熟悉认股权证的杠杆作用

### 第三章宏观经济分析0

考点3.1熟悉宏观经济分析的意义

考点3.2熟悉总量分析和结构分析的定义、特点和关系

考点3.3熟悉宏观分析资料的搜集与处理方法

考点3.4熟悉国民经济总体指标、投资指标、消费指标、金融指标、财政指标的主要内容

考点3.5熟悉各项指标变动对宏观经济的影响

考点3.6掌握国内生产总值的概念及计算方法

考点3.7熟悉国内生产总值与国民生产总值的区别与联系

考点3.8掌握失业率与通货膨胀的概念

考点3.9熟悉CPI的计算方法以及PPI与CPI的传导特征

考点3.10熟悉失业率与通货膨胀率的衡量方式

考点3.11掌握零售物价指数、生产者价格指数、国民生产总值物价平减指数概念

考点3.12熟悉国际收支、社会消费品零售总额、城乡居民储蓄存款余额、居民可支配收入等指标的

内容

考点3.13掌握货币供应量的三个层次

考点3.14熟悉金融机构各项存贷款余额、金融资产总量的含义和构成

考点3.15熟悉外汇储备及外汇储备变动情况

考点3.16掌握利率及基准利率的概念

考点3.17熟悉再贴现率、熟悉同业拆借利率、回购利率和各项存贷款利率的变动影响

考点3.18熟悉汇率的概念、汇率制度及汇率变动的的影响

考点3.19熟悉财政收支内容以及财政赤字或结余的概念

考点3.20掌握证券市场与宏观经济运行之间的关系

考点3.21熟悉中国股市表现与GDP、经济周期、通货变动对证券市场的影响

考点3.22熟悉我国证券市场指数走势与我国GDP增长趋势的实际关系

考点3.23掌握财政政策和主要财政政策手段

考点3.24熟悉积极财政政策及紧缩财政政策对证券市场的影响,掌握货币政策和货币政策工具

考点3.25熟悉货币政策的调控作用以及货币政策对证券市场的影响

考点3.26掌握收入政策含义

考点3.27熟悉收入政策的目标及其传导机制

考点3.28熟悉我国收入政策的变化及其对证券市场的影响

考点3.29熟悉国际金融市场环境对我国证券市场的影响途径

考点3.30熟悉证券市场供求关系的决定原理

考点3.31熟悉我国证券市场供需方的发展及现状

考点3.32掌握影响证券市场供给和需求的因素以及影响我国证券市场供求关系的基本制度变革

### 第四章行业分析

考点4.1掌握行业和行业分析的定义

考点4.2熟悉行业与产业的差别

考点4.3熟悉行业分析的任务、地位及意义

考点4.4熟悉行业分析与公司分析、宏观分析的关系

考点4.5掌握行业分类方法

考点4.6掌握行业的市场结构及各类市场的含义、特点及构成

考点4.7熟悉政府完全垄断与私人完全垄断的概念

考点4.8掌握行业集中度概念

考点4.9熟悉以行业集中度为划分标准的产业市场结构分类

<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

考点4.10熟悉行业竞争结构的五因素及其静动态影响

考点4.11熟悉产业价值链概念

考点4.12掌握行业的类型、各类行业的运行状态与经济周期的变动关系、具体表现、产生原因及投资者偏好

考点4.13掌握行业生命周期的含义、发展顺序、表现特征与判断标准

考点4.14熟悉处于各周期阶段的企业的风 险、盈利表现及投资者偏好

考点4.15熟悉行业衰退的种类

考点4.16熟悉判断行业生命周期的指标及其变化过程

考点4.17熟悉产出增长率的经验数据界限

考点4.18掌握行业兴衰的实质及影响因素

考点4.19熟悉技术进步的 行业特征及影响

考点4.20掌握技术产业群的划分标准

考点4.21熟悉摩尔定律、吉尔德定律等概念

考点4.22熟悉产业政策的概念、内容

考点4.23熟悉我国目前的主要产业政策

考点4.24熟悉产业组织创新的内容

考点4.25熟悉经济全球化、协议型分工和后天因素的含义

考点4.26熟悉经济全球化的主要表现及原因

考点4.27熟悉产业全球性转移、国际分工基础与模式变化的主要内容

考点4.28熟悉贸易与投资一体化理论

考点4.29熟悉历史资料研究法和调查研究法的含义与优缺点

考点4.30熟悉历史资料的来源

考点4.31熟悉调查研究的具体方式、优缺点、适用性

考点4.32掌握归纳法与演绎法、横向比较法与纵向比较法的含义

考点4.33熟悉横向比较的指标选取与判断方法

考点4.34熟悉判断行业生命周期阶段的增长预测分析方法

考点4.35掌握相关关系、时间数列的概念和分类

考点4.36熟悉因果关系与共变关系

考点4.37熟悉积矩相关系数和自相关系数的含义、数值范围及计算

考点4.38掌握一元线性回归方程的应用

考点4.39掌握时间数列的判别准则

考点4.40熟悉常用的时间数列预测方法

第五章公司分析0

考点5.1掌握公司、上市公司和公司分析的概念及公司基本分析的途径

考点5.2熟悉公司行业竞争地位的主要衡量指标

考点5.3掌握经济区位的概念

考点5.4熟悉经济区位分析的目的和途径

考点5.5熟悉自然条件、基础条件和经济特色的内容及其对公司的作用

考点5.6熟悉产业政策对公司的作用

考点5.7熟悉产品竞争能力优势的含义、实现方式

考点5.8掌握市场占有率的概念

考点5.9熟悉品牌的含义与功能

考点5.10掌握公司法人治理结构、股权结构规范和相关利益者的含义

考点5.11熟悉健全的法人治理机制的具体体现和独立董事制度的有关要求

考点5.12熟悉监事会的作用及责任

考点5.13熟悉素质的含义及公司经理人员、业务人员应具备的素质

考点5.14熟悉公司盈利能力和成长性分析的内容



<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

- 考点5.15掌握公司盈利预测的主要假设及实际预测方法
  - 考点5.16熟悉经营战略的含义、内容和特征
  - 考点5.17熟悉公司规模变动特征和扩张潜力与公司成长性的关系
  - 考点5.18熟悉公司基本分析在上市公司调研中的实际运用
  - 考点5.19熟悉资产负债表、利润分配表、现金流量表和股东权益变动表的含义、内容、格式、编制方式以及资产、负债和股东权益的关系
  - 考点5.20熟悉利润表反映的内容
  - 考点5.21熟悉使用财务报表的主体、目的以及报表分析的功能、方法和原则
  - 考点5.22熟悉比较分析法和因素分析法的含义
  - 考点5.23熟悉常用的比较方法
  - 考点5.24熟悉财务比率的含义、分类以及比率分析的比较基准
  - 考点5.25掌握公司变现能力、营运能力、长期偿债能力、盈利能力、投资收益和现金流量的计算、影响因素以及计算指标的含义
  - 考点5.26掌握流动比率与速动比率的影响因素
  - 考点5.27熟悉影响速动比率可信度的因素
  - 考点5.28熟悉影响公司变现能力的其他因素
  - 考点5.29熟悉或有负债的概念及内容
  - 考点5.30熟悉影响企业存货结构及周转速度的指标
  - 考点5.31熟悉资产负债率与产权比率、有形资产净值债务率与产权比率的关系
  - 考点5.32熟悉融资租赁与经营租赁在会计处理方式上的区别
  - 考点5.33熟悉流动性与财务弹性的含义
  - 考点5.34掌握本期到期债务的统计对象
  - 考点5.35熟悉上述指标的评价作用，变动特征与对应的财务表现以及各变量之间的关系
  - 考点5.36熟悉会计报表附注项目的主要项目
  - 考点5.37掌握会计报表附注对基本财务比率的影响
  - 考点5.38熟悉沃尔评分法的比率选取与所占比重
  - 考点5.39熟悉综合评价方法
  - 考点5.40熟悉EVA的含义及其应用
  - 考点5.41熟悉公司财务分析的注意事项
  - 考点5.42熟悉公司各类增资行为对财务结构的影响
  - 考点5.43熟悉公司重大事件的基本含义及相关内容
  - 考点5.44熟悉公司资产重组和关联交易的主要方式、具体行为、特点、性质以及与其相关的法律规定
  - 考点5.45熟悉资产重组和关联交易对公司业绩和经营的影响
  - 考点5.46熟悉运用市场价值法、重置成本法、收益现值法评估公司资产价值的步骤和优缺点
  - 考点5.47熟悉会计政策的含义以及会计政策与税收政策变化对公司的影响
- 第六章证券投资技术分析
- 考点6.1熟悉技术分析方法的局限性
  - 考点6.2熟悉技术分析的含义、要素、假设与理论基础
  - 考点6.3熟悉价量关系变化规律
  - 考点6.4掌握道氏理论的基本原理
  - 考点6.5熟悉技术分析方法的分类及其特点
  - 考点6.6熟悉K线图的画法
  - 考点6.7熟悉K线的主要形状及其组合的应用
  - 考点6.8熟悉趋势的含义和类型
  - 考点6.9掌握支撑线和压力线、趋势线和轨道线的含义、作用
  - 考点6.10熟悉股价移动的规律

考点6.11熟悉股价移动的形态

考点6.12掌握反转突破形态和持续形态的形成过程、特点及应用规则

考点6.13熟悉缺口的基本含义、类型、特征及应用方法

考点6.14熟悉波浪理论的基本思想、主要原理

考点6.15掌握葛兰碧的量价关系法则

考点6.16熟悉涨跌停板制度下量价关系的分析

考点6.17熟悉移动平均线的含义、特点和计算方法

考点6.18掌握葛兰威尔法则

考点6.19熟悉黄金交叉与死亡交叉的概念

考点6.20熟悉多条移动平均线组合分析方法

考点6.21熟悉平滑异同移动平均线的计算及应用法则

考点6.22熟悉威廉指标和相对强弱指标的含义、计算方法和应用法则

考点6.23熟悉乖离率、心理线、能量潮、腾落指数、涨跌比、超买超卖等指标的基本含义与计算, 熟悉其应用法则

### 第七章证券组合管理理论

考点7.1熟悉证券组合的含义、类型

考点7.2熟悉证券组合管理的意义、特点、基本步骤

考点7.3熟悉现代证券组合理论体系形成与发展进程

考点7.4熟悉马柯威茨、夏普、罗斯对现代证券组合理论的主要贡献

考点7.5掌握单个证券和证券组合期望收益率、方差的计算以及相关系数的意义

考点7.6熟悉证券组合可行域和有效边界的含义

考点7.7熟悉证券组合可行域和有效边界的一般图形

考点7.8掌握有效证券组合的含义和特征

考点7.9熟悉投资者偏好特征

考点7.10掌握无差异曲线的含义、作用和特征

考点7.11熟悉最优证券组合的含义和选择原理

考点7.12熟悉资本资产定价模型的假设条件

考点7.13掌握资本市场线和证券市场线的定义、图形及其经济意义

考点7.14掌握证券系数的含义和应用

考点7.15熟悉资本资产定价模型的应用效果

考点7.16熟悉套利定价理论的基本原理

考点7.17掌握套利组合的概念及计算, 能够运用套利定价方程计算证券的期望收益率

考点7.18熟悉套利定价模型的应用

考点7.19熟悉证券组合业绩评估原则

考点7.20熟悉业绩评估应注意的事项

考点7.21熟悉詹森指数、特雷诺指数、夏普指数的定义、作用以及应用

考点7.22熟悉债券资产组合的基本原理与方法

考点7.23掌握久期的概念与计算

考点7.24熟悉凸性的概念及应用

### 第八章金融工程学应用分析

考点8.1熟悉金融工程的定义、内容及其应用

考点8.2熟悉金融工程的技术、运作步骤

考点8.3掌握套利的基本概念和原理

考点8.4熟悉套利交易的基本原则和风险

考点8.5掌握股指期货套利和套期保值的定义、基本原理

考点8.6熟悉股指期货套利的主要方式

考点8.7掌握期现套利、跨期套利、跨市场套利和跨品种套利的概念、原理



<<2011-2012证券业从业资格考试辅>>

考点8.8熟悉Alpha套利的基本概念、原理

考点8.9掌握股值期货套期保值交易实务，主要包括套期保值的使用者、套期保值方向、套期保值合约份数计算

考点8.10掌握套期保值与期现套利的区别

考点8.11熟悉股指期货投资的风险

考点8.12熟悉风险度量方法的历史演变

考点8.13掌握VaR的概念与计算的基本原理

考点8.14熟悉VaR计算的主要方法及优缺点

考点8.15熟悉VaR的主要应用及在使用中应注意的问题

第九章证券投资咨询业务与证券分析师、投资顾问

考点9.1掌握我国证券分析师与财务投资顾问的基本内涵

考点9.2熟悉证券分析师与投资顾问的区别

考点9.3掌握证券投资咨询业务分类及其意义

考点9.4掌握证券投资顾问业务和发布证券研究报告的区别和联系

考点9.5熟悉发布证券研究报告的业务模式、流程管理与合规管理及证券投资顾问的业务模式与流程管理

考点9.6熟悉证券投资顾问业务和发布证券研究报告与证券经纪业务的关系、与证券资产管理业务的关系及与证券承销保荐、财务顾问业务的关系

考点9.7掌握我国涉及证券投资咨询业务的现行法律法规

考点9.8掌握《证券法》、《证券、期货投资咨询管理暂行办法》、《发布证券研究报告暂行规定》和《证券投资顾问业务暂行规定》、《关于规范面向公众开展的证券投资咨询业务行为若干问题的通知》以及《证券公司内部控制指引》的主要内容

考点9.9掌握职业道德的十六字原则与职业责任

考点9.10掌握《证券业从业人员执业行为准则》规定的特定禁止行为

考点9.11熟悉《国际伦理纲领、职业行为标准》对投资分析师行为标准的主要规定内容

考点9.12熟悉建立我国证券分析师自律组织的必要性

考点9.13熟悉证券分析师自律组织的性质、会员组成及主要功能

考点9.14熟悉国际注册投资分析师协会、亚洲证券与投资联合会等国外主要证券分析师自律组织的状况

考点9.15熟悉国际注册投资分析师水平考试(CIIA?考试)的特点、考试内容及在我国的推广情况

第二部分全真模拟试题

全真模拟题(一)

全真模拟题(二)

第三部分全真模拟试题答案、 考点解析与教材链接

全真模拟题(一)答案、 考点解析与教材链接

全真模拟题(二)答案、 考点解析与教材链接

章节摘录

有时,由于股价的变动,原来确认的支撑线或压力线可能不真正具有支撑或压力的作用,这就需对支撑线和压力线加以修正。

这一过程实际上是对现有各个支撑线和压力线重要性的确认。

每条支撑线和压力线在人们心目中的地位不同。

(二) 趋势线和轨道线 1. 趋势线。

(1) 趋势线的含义。

用直线将证券价格变化的趋势表示出来,这样的直线称为趋势线。

反映价格向上波动发展的趋势线称为上升趋势线;反映价格向下波动发展的趋势线则称为下降趋势线。

描述价格变动的趋势线分为长期趋势线、中期趋势线与短期趋势线三种。

反映价格变动的趋势线要随着价格波动的实际情况进行调整。

在任一发展方向上的趋势线不止一条,不同的趋势线反映了不同时期价格波动的实际走向。

(2) 趋势线的画法。

连接一段时间内价格波动的高点或低点可画出一条趋势线。

在上升趋势中,将两个低点连成一条直线,就得到上升趋势线;在下降趋势中,将两个高点连成一条直线,就得到下降趋势线。

标准的趋势线必须由两个以上的高点或低点连接而成。

上升趋势线起支撑作用,是支撑线的一种;下降趋势线起压力作用,是压力线的一种。

上升趋势线一般有两个反转低点,即下跌至某一低点开始回升,再下跌没有跌破前一低点又开始上升,则这两个低点就是两个反转低点。

同理,决定下跌趋势线也有两个反转高点,即上升至某一高点后开始下跌,回升未达前一高点又开始回跌,则这两个高点就是反转高点。

.....

编辑推荐

《证券业从业资格考试辅导用书：证券投资分析（2011-2012）》根据2011年证券业从资格考试大纲和统编教材编写。

严格遵循考纲，浓缩教材内容      考点逐条精解，附全真模拟题      考点精解配有真题随堂演练，即时强化学习效果。

答案解析同步链接教材，节省复习时间      对真题进行数量分析，推导命题规律，锁定考点。

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>