

## <<投资分析>>

### 图书基本信息

书名：<<投资分析>>

13位ISBN编号：9787811345254

10位ISBN编号：7811345250

出版时间：2009-8

出版时间：北京对外经济贸易大学出版社有限责任公司

作者：于瑾，束景虹 主编

页数：292

字数：372000

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>

## &lt;&lt;投资分析&gt;&gt;

## 前言

奉献在读者面前的这套教材，由对外经济贸易大学国际经济贸易学院教师根据多年的教学科研经验精心编写，从我国加入世界贸易组织五年过渡期结束后的2007年初开始陆续出版，是一项重要的教材建设工程。

它与我国改革开放的新时代同步发展，标志着我院为国家培养创新型高等人才所作出的一份特殊贡献。

我院历来重视教材建设，秉承50多年学科建设的经验积累，在国际经济与贸易、金融、国际运输与物流、经济学等专业领域先后出版了大量教材，在全国产生了较大的影响。

如《国际贸易实务》、《国际贸易》等累计发行近150万册，先后被评为国家级精品课程。

本系列教材的出版，是对我院近十年来学科建设成果的一次检阅。

自“九五”以来，以“211工程”建设为契机，我院对本科和研究生教育进行了认真全面的专业梳理和课程体系优化，以面向新世纪、面向全球化、面向提升学生职业生涯竞争力为导向，在课程建设和教材建设方面视野开阔、目标明确、标准严格、工作扎实，老中青三代学者共同努力，基本完成了学院所开设专业课程的教材和教学辅助资料的编写工作。

回顾我院“九五”以来课程体系建设，我们走过了一条清晰的发展之路。

首先是课程群的界定和建设，我们抓住20世纪90年代中期我国全面推进改革开放所带来的对外向型经济人才的需求急速增加的机遇，围绕着我院长期积累的在国际经济与贸易、国际金融、国际运输与物流等专业所形成的专业优势，借鉴国际上高水平大学的课程建设经验，设定了培养学生具有国际竞争力所需要的课程群。

在此基础上狠抓师资队伍建设和，通过海内外招聘和支持现有教师在国内攻读博士学位，以国际化的标准打造了一支高水平的师资队伍，凝聚了学科建设的核心力量。

然后以国际高水平大学的科研和教学标准评价师资队伍，以高水平科研促进高水平教学，实现科研与教学的相互促进。

随着学科建设的不断进步，我院的专业领域和课程覆盖面均有了很大的突破。

## <<投资分析>>

### 内容概要

充分借鉴国外经典投资学教材成果。

全面、深入、系统地介绍西方投资学基础理论和基本原理，结合我国证券市场，上市公司的真实数据进行案例分析。

强调实证研究和定量分析，注重投资原理在我国证券投资实践中的应用。

本书是金融学专业的核心课程，也是微观金融的重要组成部分。

本教材在充分吸收国外经典投资学教材成果的基础上，力图系统深入地介绍西方投资学基本理论和主要原理，同时注重联系我国证券市场的实际，使学生在全面掌握西方证券投资的基本原理的同时，注重投资理论在证券投资实践中的应用。

## <<投资分析>>

### 作者简介

于瑾，对外经济贸易大学国际经贸学院教授，博士生导师，主要从事“证券投资”、“基金管理”，“国际金融市场”等领域的教学和研究，曾出版《利率期限结构理论》、《国际金融市场》等著作，在《国际金融研究》、《财贸经济》等国内核心期刊发表学术论文多篇。

束景虹，香港城市大学经济学博士，对外经济贸易大学国际经济贸易学院副教授，为本科生、研究生、博士生讲授“证券投资学”、“公司金融理论”、“衍生金融市场”、“实证金融”等课程。主要研究方向为资产定价和公司金融，在《世界经济》、Journal of Futures Markets等国内外著名学术期刊发表学术论文多篇。

## &lt;&lt;投资分析&gt;&gt;

## 书籍目录

- 第一章 投资学概论
  - 第一节 投资及投资过程
  - 第二节 证券投资工具
  - 第三节 证券市场
  - 复习思考题
- 第二章 投资组合理论
  - 第一节 证券组合的风险与收益
  - 第二节 最优风险证券组合
  - 复习思考题
- 第三章 资本市场均衡模型
  - 第一节 资本资产定价模型
  - 第二节 因素模型
  - 第三节 套利定价理论
  - 复习思考题
- 第四章 债券的定价
  - 第一节 债券定价原理
  - 第二节 债券的特性
  - 第三节 债券的收益率
  - 复习思考题
- 第五章 债券投资组合管理
  - 第一节 债券的利率风险度量
  - 第二节 债券组合管理策略
  - 复习思考题
- 第六章 宏观经济分析
  - 第一节 宏观经济分析的意义和主要内容
  - 第二节 宏观经济运行分析
  - 第三节 经济周期分析
  - 第四节 宏观经济政策分析
  - 复习思考题
- 第七章 行业分析
  - 第一节 行业分析概述
  - 第二节 经济周期与行业分析
  - 第三节 行业的生命周期分析
  - 第四节 行业的市场结构和竞争分析
  - 复习思考题
- 第八章 公司财务分析
  - 第一节 财务报表分析概述
  - 第二节 财务比率分析
  - 复习思考题
- 第九章 权益的估值模型
  - 第一节 股利折现模型
  - 第二节 自由现金流折现模型
  - 第三节 剩余收益模型
  - 第四节 相对价值模型
  - 复习思考题

## <<投资分析>>

### 第十章 技术分析

#### 第一节 技术分析的理论基础

#### 第二节 技术分析的主要理论及方法

#### 第三节 常用的技术分析指标

#### 复习思考题

### 第十一章 证券投资基金组合管理的业绩评价

#### 第一节 基金业绩评价概述

#### 第二节 基金业绩评价的传统方法及改进

#### 第三节 基金择时能力评价

#### 第四节 基金业绩归属分析

#### 复习思考题

#### 参考资料

## &lt;&lt;投资分析&gt;&gt;

## 章节摘录

## (2) 生产技术。

技术进步快的行业，创新能力强，生产率上升快，容易保持优势地位，其成长性也强。

## (3) 产业关联度。

产业关联度强的行业，成长性也强。

## (4) 市场容量与潜力。

市场容量和市场潜力大的行业，其成长空间也大。

## (5) 行业在空间的转移活动。

行业在空间转移活动停止，一般可以说明行业成长达到市场需求边界，成长期也就进入尾声。

## (6) 产业组织变化活动。

在行业成长过程中，一般伴随着行业中企业组织不断向集团化、大型化方向发展。

进入这个阶段以后，产品逐渐被消费者认可，市场发展迅速，需求量很大，销售增长的非常快。行业中公司数目有限，几乎没有竞争，公司的利润较高。

这个时候，一些拥有较强研究开发实力、市场营销能力、雄厚资本实力和畅通融资渠道的企业逐渐占领市场，成为行业的领导者。

另一方面，由于高额的利润，大量的新公司加入进来，行业的竞争程度明显激烈，行业由高速增长转为稳定增长。

(三) 成熟阶段 当行业稳定增长了一段时期后，由于生产技术、生产工艺、以及产品式样、功能等都趋向成熟，市场需求也趋向饱和，行业高增长率已无法再维持，行业进入成熟阶段。

在这个阶段，产品的普及程度已经达到了消费市场可以容纳的最大量，行业得增长可能只是因为经济整体在发展得缘故。

同时，更多的企业加入进来生产同类的产品，价格的竞争十分激烈，产品的边际利润降低，投资也变得缓慢，公司开始派发比较多的股利，成为“现金牛”。

(四) 衰退阶段 当一个行业进入到衰退阶段，它的增长速度往往低于经济的发展速度，甚至出现负增长。

这可能是由于产品过时了，也可能因为消费市场的需求发生了变化，也可能是国外低价产品的竞争。

<<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:<http://www.tushu007.com>