

# 《理财投资策划》

## 书籍信息

版次：1

页数：408

字数：295000

印刷时间：2008年08月01日

开本：32开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787501785124

## 内容简介

本书一方面保留了部分必要的公式、图表，便于学生全面了解、把握；另一方面更加注重对相关理论主要观点、内容和结论的提炼，以及对投资活动的具体指导等。通过学习，学生不但可以了解我国现有理财产品的种类、特点，还可了解各个理财市场的运行历史与现状，并把握可能出现的投资机会。这些内容既是大学本科金融理财策划专业方向学生的必备知识，也是各类投资机构开拓相关业务的\*参考。

## 目录

### 第一章 投资组合理论

#### 第一节 投资组合理论的基本含义

- 一、投资组合理论的定义与研究目的
- 二、金融资产投资的收益与收益率
- 三、金融资产投资的风险及其种类
- 四、金融理财投资组合的操作程序

#### 第二节 均值方差模型

- 一、投资组合的收益、方差和协方差
- 二、有效边界的确定
- 三、效用分析与最优投资组合
- 四、无风险借贷的扩展模型

#### 第三节 单指数模型与多指数模型

- 一、单指数模型的基本结构
- 二、单指数模型的参数估计与风险的分散化
- 三、多指数模型的内涵与种类

#### 第四节 资本资产定价模型

- 一、资本资产定价模型的假设条件
- 二、资本市场线
- 三、证券市场线
- 四、异质预期
- 五、证券特征线

#### 第五节 资本资产套利模型

- 一、套利定价的基本含义
- 二、套利定价模型的种类
- 三、套利定价模型的资本资产定价模型比较
- 四、三因素模型

### 第二章 其他投资理论

#### 第一节 有效市场假说

- 一、有效市场假说的基本含义

二、有效市场假说的具体形式

三、有效市场假说的实证检验

## 第二节 行为金融理论

一、行为金融理论的产生背景

二、行为金融理论的主要观点

## 第三节 分形市场假说

一、分形市场假说的基本内容与实证检验

二、分形市场假说与有效市场假说的区别

三、分形市场假说对理财投资的启示

四、分形市场假说的理论延伸

## 第三章 股票投资组合策划

### 第一节 股票概述

一、股票的定义与特点

二、普通股

三、优先股

四、我国对股票的分类

### 第二节 股票投资风险与股票定价

一、股票价值的不同体现

二、影响股票价格变动的因素

三、股票投资风险的测量方法

四、股票定价

### 第三节 股票投资价值的基本分析

一、公司基本情况分析

二、公司财务状况分析

三、行业与宏观分析

### 第四节 股票投资价值的技术分析

一、技术分析的基本含义

二、K线分析

三、价格指数分析

四、成交量指标分析

五、心理指标分析

### 第五节 股票投资理论

一、江恩理论

二、波浪理论

三、道式理论

四、随机漫步理论

## 第四章 债券投资组合策划

### 第一节 债券概述

一、债券常识

二、政府债券

三、公司债券

四、国际债券

## 第二节 债券的收益与风险

- 一、债券的收益率
- 二、债券的投资风险与信用评级
- 三、债券定价

## 第三节 债券的久期与凸性

- 一、债券的收益率曲线
- 二、债券的久期
- 三、债券的凸性

## 第四节 债券组合投资策略

- 一、被动型组合投资策略
- 二、主动型组合投资策略
- 三、被动型与主动型组合投资策略的比较

## 第五节 我国债券市场的交易规则

- 一、我国债券的种类
- 二、我国证券交易所债券的交易规则
- 三、我国柜台市场债券的交易规则
- 四、我国债券的回购与转托管

## 第五章 存款与基金的投资组合策划

### 第一节 储蓄存款的组合策划

- 一、我国储蓄存款的基本原则与计息方法
- 二、我国储蓄存款的常见类型
- 三、我国储蓄存款的利率结构与理财策略

### 第二节 人民币理财产品的组合策划

- 一、人民币理财产品的定义与种类
- 二、人民币理财产品在我国的主要投资对象
- 三、人民币理财产品的组合投资策略

### 第三节 外汇理财产品的组合策划

- 一、个人实盘外汇买卖
- 二、个人外汇期权买卖
- 三、个人外汇结构性理财产品买卖
- 四、外汇理财产品的组合投资策略

### 第四节 投资基金的组合策划

- 一、投资基金的定义与发展历史
- 二、投资基金的类型
- 三、投资基金的运作程序
- 四、投资基金的风险控制
- 五、投资基金的组合策略

## 第六章 其他金融产品的投资组合策划

### 第一节 信托产品投资策划

- 一、信托概述
- 二、信托公司集合资金信托计划管理
- 三、信托公司受托境外理财业务管理

## 四、我国信托产品的资金运用方式

### 第二节 衍生金融产品投资策划

- 一、衍生金融产品概述
- 二、金融期货投资策划
- 三、金融期权投资策划
- 四、金融远期和互换投资策划

### 第三节 黄金产品投资策划

- 一、黄金产品概述
- 二、影响黄金价格的主要因素
- 三、黄金投资在我国的发展

## 第七章 组合投资管理实务

### 第一节 客户情况分析

- 一、客户基本情况调查
- 二、客户投资类型问卷分析
- 三、客户财务状况分析
- 四、客户家庭生命周期分析

### 第二节 组合投资策略分析

- 一、组合投资的经典经验
- 二、组合投资的资金分配技巧
- 三、组合投资的常用方法

### 第三节 组合投资案例分析

- 一、股票型基金组合投资案例
- 二、动态策略基金组合投资案例
- 三、资源优选型基金组合投资案例
- 四、指数型基金组合投资案例
- 五、混合型基金组合投资案例

### 主要参考文献

## 在线试读部分章节

### 第一章 投资组合理论

#### 本章要点

投资组合理论的基本含义

历史收益率与预期收益率

金融理财投资组合的损伤程序

均值方差模型

有效集定理与分离定理

单指数模型与多指数模型

资本资产定价模型

## 资本资产套利模型

### 第一节 投资组合理论的基本含义

#### 一、投资组合理论的定义与研究目的

##### (一) 投资组合理论的定义

.....

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.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)