

# 《证券投资学（第四版）（经济管理类课程教材·金融系列；“十二五”普通高等教育本科国家级规划教材）》

## 书籍信息

版次：4

页数：

字数：674000

印刷时间：2014年02月01日

开本：12k

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787300184173

## 内容简介

《证券投资学》（第四版）是在第三版教材的基础上，经全面修订而成。这次修订充分借鉴了国内外金融证券研究领域的一些\*研究成果，调整了有关的章节内容，增加了描述量化投资的内容并力求贴近和反映中国资本市场近年来的改革实践，以满足证券投资学的教学需要。

全书除导论外共分为五篇。

第一篇是基础知识篇，系统讲述关于证券投资工具、证券市场和资产定价的一般性基础知识。这是深入进行资本市场领域和证券投资研究所必需的基础知识。

第二篇是基本分析篇，系统讲述证券投资的宏观经济分析、产业周期分析、公司财务分析和公司价值分析等内容。

第三篇是技术分析篇，系统讲述证券投资技术分析的基本理论、方法和若干主要技术指标。

第四篇是组合管理篇，系统讲述证券组合管理、投资组合管理业绩评价等内容。

第五篇是量化分析与交易策略篇，是新增的内容，介绍了量化投资的基本要求和相关交易策略。

本教材可作为高等院校财经类各专业特别是金融学专业的本科教材，也可以作为金融证券从业人员和证券投资者系统学习相关理论知识的参考用书。

## 作者简介

吴晓求，1959年2月生，金融证券研究专家，1990年在中国人民大学获经济学博士学位。现任中国人民大学校长助理、研究生院常务副院长、金融与证券研究所所长、财政金融学院教授、博士生导师，教育部长江学者特聘教授、中国人民大学学位委员会副主席、北京市学位委员会委员、全国金融硕士专业学位教育指导委员会副主任委员、国务院学位委员会学科评议组成员、国家社科基金管理学科评审组成员、中国证监会第九届发审委委员，中国金融学会常务理事。

吴晓求教授在《中国社会科学》、《经济研究》、《金融研究》、《财贸经济》、《管理世界》等重要学术期刊发表论文近百篇，近期代表性著作主要有《资本市场解释》（2002）、《中国资本市场分析要义》（2006）、《梦想之路——吴晓求资本市场研究文集》（2007）、《金融危机启示录》（2009）、《证券投资学》（2009）、《变革与崛起——探寻中国金融崛起之路》（2011）、《中国证券公司：现状与未来》（2012）、《金融理论与政策》（2013）等。

## 目录

# 导论

## 第一篇 基本知识篇

### 第1章 证券投资工具

- 1.1 投资概述
- 1.2 债券
- 1.3 股票
- 1.4 证券投资基金
- 1.5 金融衍生工具
- 1.6 另类投资工具

### 第2章 证券市场

#### 2.1 证券市场概述

#### 第一篇 基本知识篇

第1章 证券投资工具 1.1 投资概述 1.2 债券 1.3 股票 1.4 证券投资基金 1.5 金融衍生工具 1.6 另类投资工具

第2章 证券市场 2.1 证券市场概述 2.2 证券市场的运行机制 2.3 证券市场监管

第3章 资产定价理论及其发展 3.1 20世纪50年代以前的 资产定价理论 3.2

20世纪50年代至80年代的 资产定价理论 3.3

20世纪80年代以后兴起的 行为金融资产定价理论

第二篇 基本分析篇 第4章 证券投资的宏观经济分析 4.1 宏观经济分析概述 4.2

宏观经济运行对证券市场的影响 4.3 宏观经济政策与证券市场

第5章 证券投资的产业分析 5.1 产业的基本特征分析 5.2 产业生命周期分析 5.3

产业结构分析

第6章 公司财务分析 6.1 概述：如何阅读上市公司的财务报表 6.2

基于资产负债表的 资产管理分析 6.3 基于损益表的经营效益分析 6.4

基于现金流量表的 现金流分析

第7章 公司价值分析 7.1 公司基本分析 7.2 资本结构——企业价值与股权价值 7.3

绝对估值法 7.4 相对估值法

#### 第三篇 技术分析篇

第8章 证券投资技术分析概述 8.1 技术分析的 理论基础 8.2

市场行为的四个要素：价、量、时、空 8.3 技术分析方法的分类和局限性 8.4

与技术分析有关的几个理论 8.5 价量配合的案例分析

第9章 技术分析的主要理论和方法 9.1 道氏理论 9.2 K线理论 9.3 支撑压力 9.4

形态理论 9.5 波浪理论 9.6 技术指标

#### 第四篇 组合管理篇

第10章 证券组合管理 10.1 证券组合管理概述 10.2 马科维茨选择资产组合的方法

第11章 风险资产的定价与证券组合管理的应用 11.1 资本资产定价模型 11.2

套利定价理论 11.3 期权定价理论

第12章 投资组合管理业绩评价模型 12.1 投资组合管理业绩评价概述 12.2

单因素投资基金业绩评价模型 12.3 多因素整体业绩评估模型 12.4

时机选择与证券选择能力评估模型 12.5 进一步的研究

第13章 债券组合管理 13.1 债券定价理论 13.2 可转换债券定价理论

第五篇 量化分析与交易策略篇

第14章 量化投资与信息比率 14.1 量化投资的基本概念 14.2 信息比率的定义 14.3

信息比率的应用 14.4 信息比率与其他比率的比较 14.5 的预测与前瞻信息比率

第15章 配对交易策略 15.1 配对交易概述 15.2 距离交易的交易策略 15.3

配对交易分类 15.4 配对交易的实施难点

参考文献

[显示全部信息](#)

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)