

## 课程名称：投资分析与管理

时间：12-18 小时

主要内容：

### 一、投资风险理论与投资组合理论

投资组合理论

风险的量度

资本资产定价模型

风险与收益

系统性风险与非系统性风险

分散化投资策略

### 二、金融资产定价方法

金融资产的相对估值法

市盈率估值法

市净率估值法

现金流贴现估值法

债券的定价方法与分析

股票的定价方法与分析

### 三、金融衍生工具的估值方法及其投资策略

掉期交易

预托证券

远期合约

期货交易

期权交易

### 四、证券投资基金及其运作

基金的种类

基金的运作特点

基金的管理模式

基金的投资策略

### 五、行为金融理论

资本市场的有效率性

投资者的过度自信

赌资效应

投资者的非理性选择

### 六、市场周期分析与投资策略

道氏理论的基本原理

市场周期理论

从沪深股市市盈率的周期变化看投资风险与机会

## 七、证券市场技术分析

移动平均线

趋势线分析

形态分析

波浪理论