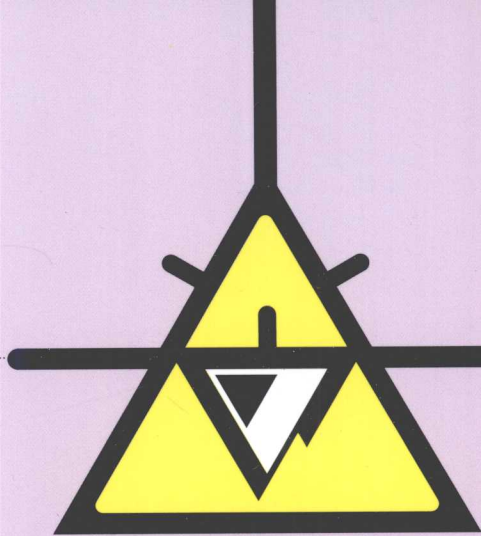




普通高等教育规划教材



证券投资 实训

第2版

Practice of Securities Investment

孙可娜 主编



机械工业出版社
CHINA MACHINE PRESS



普通高等教育规划教材

证券投资实训

第2版

主 编 孙可娜

副主编 李 健

参 编 刘临娟 徐焕强



机械工业出版社

本书是与《证券投资教程》(孙可娜主编)相配套,以培养和训练证券投资操作能力为目的的实训教材。本书以证券投资操作为特点,以网上证券投资为引领,通过证券投资模拟方式进行技术分析和实务操作。全书主要内容包括:证券投资预备知识、软件下载与安装、行情分析方法与操作、系统软件功能介绍、技术分析方法与应用、网上证券委托、证券投资模拟、网上信息采集。

本书适用于学生进行网上模拟证券投资,进行专业实验室实际训练,同时还可作为高校学生自助练习、证券从业人员资格考试的参考资料。

图书在版编目(CIP)数据

证券投资实训/孙可娜主编. —2版. —北京:机械工业出版社, 2009.11

普通高等教育规划教材

ISBN 978-7-111-28300-3

I. 证… II. 孙… III. 证券投资—高等学校—教材
IV. F830.91

中国版本图书馆CIP数据核字(2009)第164087号

机械工业出版社(北京市百万庄大街22号 邮政编码100037)

策划编辑:曹俊玲 责任编辑:曹俊玲

责任校对:常天培 责任印制:杨曦

北京鑫海金澳胶印有限公司印刷

2010年1月第2版第1次印刷

169mm×239mm·12印张·296千字

标准书号:ISBN 978-7-111-28300-3

定价:21.00元

凡购本书,如有缺页、倒页、脱页,由本社发行部调换

电话服务

网络服务

社服务中心:(010)88361066

门户网:<http://www.cmpbook.com>

销售一部:(010)68326294

教材网:<http://www.cmpedu.com>

销售二部:(010)88379649

读者服务部:(010)68993821

封面无防伪标均为盗版

前 言

通过网络方式进行证券买卖,已经成为信息时代证券投资的主要方式。熟练地进行证券行情与交易软件的下载、安装与使用;详尽地了解和使用分析系统的各种主要功能,方便快捷地在大盘和个股之间进行技术分析;选择相应的网站,申请登录个人的网上证券投资账户进行网上证券委托买卖;申请建立个人的模拟账户进行证券委托买卖的模拟训练;得心应手地获取网上信息资源,对证券市场的有关信息进行搜集、整理、分析和判断,这体现了证券投资的学习必须与实际训练相结合,证券投资的实际操作是不可缺少的基本专业能力。把所学的知识转换成能力,加强与实践环节的配套,注重对学生专业能力的培养,已经成为新形势下社会培养专业人才的重要指向。

“证券投资”作为高等院校经济管理类专业课程,不仅需要系统学习、了解和掌握有关证券投资的理论,而且需要拥有必要的实务操作能力。本教材正是基于实际操作能力训练的需要,作为与《证券投资教程》配套的实训教材,组织高校中具有证券从业经历的教师和证券机构的专业人员共同编写。实践证明,本实训教材的编写,在证券投资模拟训练方面作了积极的尝试,并取得了预期的效果。

本次再版,在结构上没有进行大的改动,而是结合证券投资实际操作的需要,在原有基础上,对有关网页及内容进行了新的替换,同时,加入了证券投资的基础性、技术性、经验性的相关内容,以便于同学在实训中获得必要的引领。

第1版各章的编写人员为:第一章、第三章由孙可娜、刘临娟编写;第二章、第四章、第五章由刘临娟编写;第六章由李健、刘临娟编写;第七章由孙可娜、徐焕强编写;第八章由徐焕强编写。技术资源由李健负责组织,全书由孙可娜总纂定稿。本次再版,由孙可娜对



全书进行了修订。

我国证券市场是一个不断发展的市场，新的内容和领域不断涌现，没有尽头。特别是由于编者的水平所限，本实训教材在内容上不可能包罗万象，只是一个操作的引领，更深入、更广阔的领域还有待大家在实践中去探索。欢迎读者对本书提出批评和建议。

目 录

前言

第一章 证券投资预备知识	1
第一节 证券交易品种及代码	1
第二节 证券交易相关规定	21
第三节 证券托管登记制度	24
第二章 软件下载与安装	31
第一节 证券网上交易	31
第二节 网上行情查询与软件下载	32
第三节 网上交易软件的安装与使用	39
第三章 行情分析方法与操作	44
第一节 大盘分析	44
第二节 股价指数及走势分析	46
第三节 证券行情分类报价	53
第四节 个股分析	57
第四章 系统软件功能介绍	63
第一节 系统参数设置	63
第二节 技术分析参数设置	70
第三节 常用工具	74
第五章 技术分析方法与应用	85
第一节 技术分析的基本原理	85
第二节 移动成本分析	87
第三节 技术指标及其应用	89
第六章 网上证券委托	121
第一节 委托设置	121
第二节 委托买卖	127
第三节 账户查询	132



第七章 证券投资模拟	145
第一节 建立模拟账户	145
第二节 模拟交易	150
第八章 网上信息采集	156
第一节 证券信息采集	156
第二节 信息搜索方法	159
第三节 资讯网站的收藏	168
附录	184
参考文献	186

第一章 证券投资预备知识



本章指引:

在进入网上证券投资实际训练之前,请不必过于匆忙。在这里回顾或了解证券投资的预备知识,对于接下来的实际操作来说不仅极为必要,而且会起到事半功倍的效果。

第一节 证券交易品种及代码

在证券交易过程中,为了便于计算机识别和交易,每一只上市证券都会拥有一个专有的证券代码。证券简称与代码一一对应,为证券投资带来了便利。例如,浦发银行,其代码为 600000;上海机场,其代码为 600009。进行信息查询和证券交易时,输入有关的证券代码,接下来的环节就会变得轻而易举。因此,获取证券代码应该是我们入市进行证券投资的一把钥匙。

在网上,可以通过多种方式进行证券代码的查询。例如,输入“股票代码对照表”,可以很方便地进行各类证券代码的查询。

一、股票及其代码

1. A 股股票代码

A 股股票即人民币普通股,是由我国境内的公司发行,供境内机构、组织或个人(不含台湾、香港、澳门投资者)以人民币认购和交易的普通股股票。

根据上海证券交易所(简称“上交所”)“证券编码实施方案”,在上交所上市的证券,采用 6 位数编制方法,前 3 位数用以区别证券品种,具体如下所列:001×××国债现货;201×××国债回购;110×××、120×××企业债券;129×××、100×××可转换债券;310×××国债期货;500×××、550×××基金;600×××A 股;700×××配股;710×××转配股;701×××转配股再配股;711×××转配股再转配股;720×××红利;730×××新股申购;735×××新基金申购;900×××B 股;737×××新股配售。

图 1-1 为沪市部分 A 股股票证券代码对照表。



600002	齐鲁石化	600003	东北高速
600004	白云机场	600005	武钢股份
600005	武钢股份	600006	东风汽车
600007	中国国贸	600008	首创股份
600008	首创股份	600009	上海机场
600010	钢联股份	600011	华能国际
600011	华能国际	600012	皖通高速
600015	华夏银行	600016	民生银行
600018	民生银行	600018	上港集箱
600019	宝钢股份	600020	中原高速
600020	中原高速	600026	中海发展
600028	中国石化	600029	南方航空
600029	南方航空	600030	中信证券

图 1-1 沪市部分 A 股股票证券代码对照表

在深圳证券交易所（简称“深交所”）上市交易的 A 股股票，其交易代码由“00”打头的 6 位数组成。在深圳证券交易所上市的证券，证券编码采用 6 位数编制方法，首位为证券品种区别代码，具体如下所示：000 × × × A 股；001 × × × 企业债券、国债回购、国债现货；002 × × × B 股及 B 股权证；003 × × × 转配股权证；004 × × × 基金；005 × × × 可转换债券；006 × × × 国债期货；007 × × × 期权；008 × × × 配股权证；009 × × × 新股配售。2004 年深圳证券交易所推出中小企业板，其代码为 002 × × ×。其中，“2”表示中小企业板块，后 3 位数表示上市顺序。

图 1-2 为深市部分 A 股股票证券代码对照表。

2. B 股股票代码

B 股股票即人民币特种股票，是以人民币标明流通面值，以外币认购和交易的特种股股票。

B 股公司的注册地和上市地都在境内（深、沪证券交易所），只不过投资者在境外或在中国香港、澳门及台湾。2001 年，我国境内居民个人可以从事 B 股投资。

在上交所挂牌交易的 B 股股票交易以美元为计价单位，而在深交所挂牌交易的 B 股股票交易以港币为计价单位。

在上交所挂牌的 B 股股票代码由“900 × × ×”的 6 位数组成，其中“900”代表在上交所上市交易的 B 股股票，具体代码区间为 9009 × ×，如图 1-3 所示。

股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

文件(F) 编辑(E) 查看(V) 收藏(A) 工具(T) 帮助(H)

后退 前进 停止 刷新 搜索 收藏夹 媒体

地址(1) http://www.businessime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm 转到 链接

股票名称代码对照表

000001	深发展A	000002	深万科A
000002	深万科A	000003	PT金田A
000004	北大高科	000005	ST星源
000005	ST星源	000006	深振业A
000007	深达声A	000008	ST亿安
000008	ST亿安	000009	深宝安A
000010	ST深华新	000011	ST深物业
000011	ST深物业	000012	南玻科技
000013	ST石化A	000014	沙河股份
000014	沙河股份	000015	PT中浩A

完毕 Internet

图 1-2 深市部分 A 股股票证券代码对照表

股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

文件(F) 编辑(E) 查看(V) 收藏(A) 工具(T) 帮助(H)

后退 前进 停止 刷新 搜索 收藏夹 媒体

地址(1) http://www.businessime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm 转到 链接

900904	永生B股	900905	中铅B股
900906	中纺B股	900907	发展B股
900907	发展B股	900908	氯碱B股
900909	轮胎B股	900910	海立B股
900910	海立B股	900911	金桥B股
900912	外高B股	900913	联华B股
900913	联华B股	900914	新锦B股
900915	ST永久B	900916	凤凰B股
900916	凤凰B股	900917	海欣B股
900918	耀皮B股	900919	ST大江B
900919	ST大江B	900920	上柴B股
900921	大盈B股	900922	三毛B股
900922	三毛B股	900923	友谊B股

完毕 Internet

图 1-3 沪市部分 B 股股票证券代码对照表



在深交所挂牌交易的 B 股股票代码由“20 × × × ×”的 6 位数组成。其中“20”表示 B 股股票，第 3 到第 6 位为顺序编码区，取值范围为 0001 ~ 9999。目前具体代码区间为 20000 × ~ 2009 × ×，如图 1-4 所示。

股票代码	股票名称	股票代码	股票名称
200003	PT金田B	200011	ST物业B
200011	ST物业B	200012	深南玻B
200013	ST石化B	200015	PT中浩B
200015	PT中浩B	200016	深康佳B
200017	ST中华B	200018	深中冠B
200018	深中冠B	200019	深深宝B
200020	深华发B	200022	深赤湾B
200022	深赤湾B	200024	招商局B
200025	ST特力B	200026	飞亚达B
200026	飞亚达B	200028	一致B
200029	深深房B	200030	ST盛润B
200030	ST盛润B	200037	深南电B
200039	中集B	200041	深本实B

图 1-4 深市部分 B 股股票证券代码对照表

二、封闭式基金及其代码

投资基金就是汇集众多分散投资者的资金，委托投资专家（如基金管理人），由投资管理专家按其投资策略，统一进行投资管理，为众多投资者谋利的一种证券投资工具。证券投资基金集合大众资金，共同分享投资利润，分担风险，是一种利益共享、风险共担的集合投资方式。证券投资基金按照发行规模是否固定可划分为封闭式基金和开放式基金。

封闭式基金是指设立基金时，规定基金的封闭期限及发行规模，在封闭期内投资者不能向基金经理公司赎回现金，但是可以在证券市场上以竞价方式进行转让。开放式基金在基金设立时，不确定基金规模，投资者可以随时按基金资产净值购买基金受益单位，也可随时按基金资产净值向基金经理公司赎回基金单位的一种基金。因此，进入证交所进行交易的基金一般属于封闭式基金。

在上交所挂牌交易的证券投资基金代码由“500 × × ×”的 6 位数组成。具体基金代码区间为 50000 × ~ 5000 × ×，如图 1-5 所示。



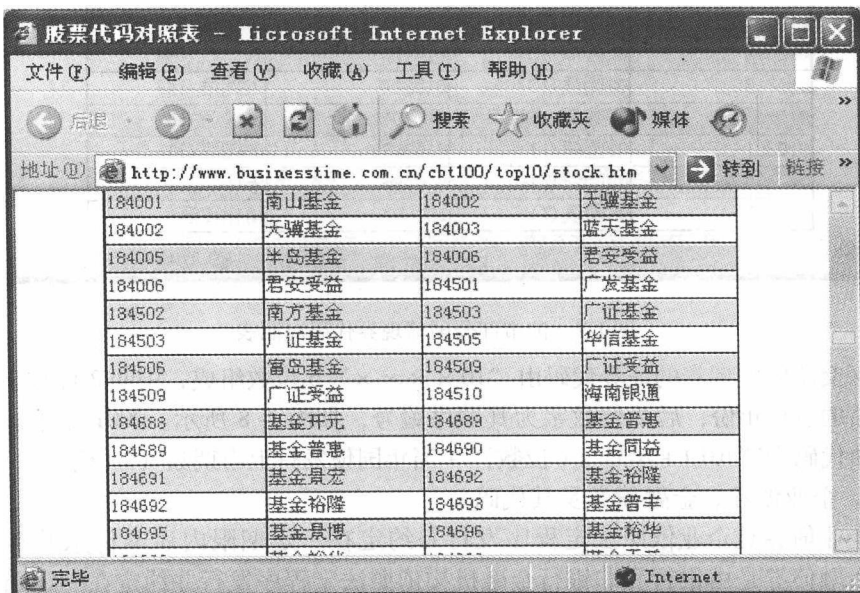
股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

地址: <http://www.businessstime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm>

500006	基金裕阳	500007	基金景阳
500008	基金兴华	500009	基金安顺
500009	基金安顺	500010	基金金元
500011	基金金鑫	500013	基金安瑞
500013	基金安瑞	500015	基金汉兴
500016	基金裕元	500017	基金景业
500017	基金景业	500018	基金兴和
500019	基金管润	500021	基金金鼎
500021	基金金鼎	500025	基金汉鼎
500028	基金兴业	500029	基金科讯
500029	基金科讯	500035	基金汉博
500038	基金通乾	500039	基金同德
500039	基金同德	500056	基金科瑞

图 1-5 沪市部分证券投资基金代码对照表

在深交所挂牌交易的证券投资基金代码由“18××××”的6位数组成。其中“18”表示证券投资基金，第3到第6位为顺序编码区，取值范围为0001~9999。目前具体代码区间为1846××~1847××，如图1-6所示。



股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

地址: <http://www.businessstime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm>

184001	南山基金	184002	天骥基金
184002	天骥基金	184003	蓝天基金
184005	半岛基金	184006	君安受益
184006	君安受益	184501	广发基金
184502	南方基金	184503	广证基金
184503	广证基金	184505	华信基金
184506	富岛基金	184509	广证受益
184509	广证受益	184510	海南银通
184688	基金开元	184689	基金普惠
184689	基金普惠	184690	基金同益
184691	基金景宏	184692	基金裕隆
184692	基金裕隆	184693	基金普丰
184695	基金景博	184696	基金裕华

图 1-6 深市部分证券投资基金代码对照表



三、债券及其证券代码

1. 国债及其证券代码

国债是中央政府为筹集财政资金而发行的一种政府债券，是中央政府向投资者出具的、承诺在一定时期支付利息和到期偿还本金的债权债务凭证。

上交所国债现券的证券代码由“01××××”的6位数组成，中间2位数字为该国债的发行年份，后2位数字为其顺序编号；2000年以前上交所国债现券代码由“00××××”的6位数组成，中间2位数为该国债的发行年份，后2位数为其顺序编号，如图1-7所示。

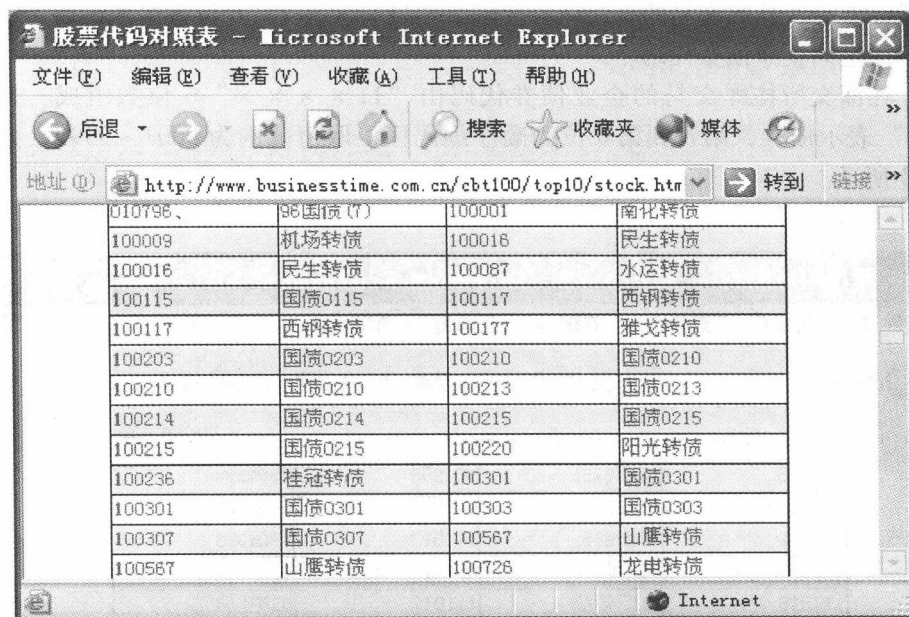
009704	97国债(4)	009905	99国债(5)
009908	99国债(8)	010004	20国债(4)
010004	20国债(4)	010010	20国债(10)
010103	21国债(3)	010107	21国债(7)
010107	21国债(7)	010110	21国债(10)
010112	21国债(12)	010115	21国债(15)
010115	21国债(15)	010203	02国债(3)
010210	02国债(10)	010213	02国债(13)
010213	02国债(13)	010214	02国债(14)
010215	02国债(15)	010301	03国债(1)
010301	03国债(1)	010303	03国债(3)
010307	03国债(7)	010796	96国债(7)
010796	96国债(7)	100001	南化转债

图 1-7 沪市部分国债现券代码对照表

深交所国债现券的证券代码由“10××××”6位数组成，中间2位数字为该期国债的发行年份，后2位数字为其顺序编号，如图1-8所示。2001年十五期以前国债代码为“1019+年号(1位数)+当年国债发行上市期数(1位数)”。

2. 企业债券、金融债券及其代码

企业债券是企业依照法定程序发行并约定在一定期限内还本付息的有价证券。金融债券是由银行和非银行金融机构依照法定程序发行并约定在一定期限内还本付息的有价证券。



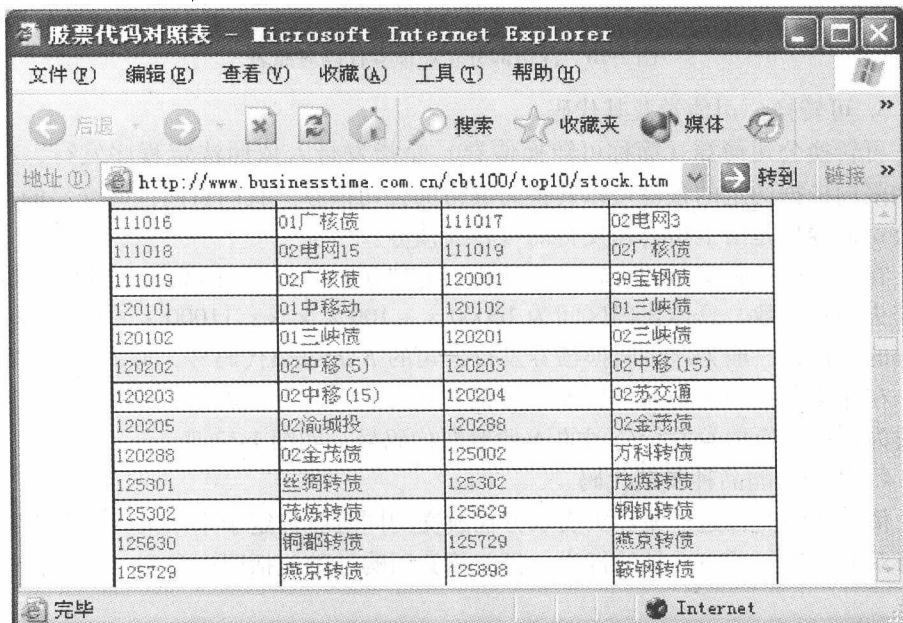
股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

地址: <http://www.businessime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm>

010798	98国债(7)	100001	南化转债
100009	机场转债	100018	民生转债
100016	民生转债	100087	水运转债
100115	国债0115	100117	西钢转债
100117	西钢转债	100177	雅戈转债
100203	国债0203	100210	国债0210
100210	国债0210	100213	国债0213
100214	国债0214	100215	国债0215
100215	国债0215	100220	阳光转债
100236	桂冠转债	100301	国债0301
100301	国债0301	100303	国债0303
100307	国债0307	100567	山鹰转债
100567	山鹰转债	100726	龙电转债

图 1-8 深市部分国债现券代码对照表

在上交所挂牌交易的企业债券代码由“12××××”6位数组成,中间2位数字为该债券的上市年份,最后2位数字为该债券的上市顺序编号,如图1-9所示。



股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

地址: <http://www.businessime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm>

111016	01广核债	111017	02电网3
111018	02电网15	111019	02广核债
111019	02广核债	120001	99宝钢债
120101	01中移动	120102	01三峡债
120102	01三峡债	120201	02三峡债
120202	02中移(5)	120203	02中移(15)
120203	02中移(15)	120204	02苏交通
120205	02渝城投	120288	02金茂债
120288	02金茂债	125002	万科转债
125301	丝桐转债	125302	茂炼转债
125302	茂炼转债	125629	钢钒转债
125630	铜都转债	125729	燕京转债
125729	燕京转债	125898	鞍钢转债

图 1-9 沪市部分企业债券代码对照表



在上交所挂牌交易的金融债券代码由“11××××”6位数组成,后4位数字的设定同企业债券代码。

在深交所挂牌交易的企业债券代码由“11××××”6位数组成。其中“11”表示债券,第3到第6位为顺序编码区,取值范围为0001~9999,如图1-10所示。

股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer			
文件(F) 编辑(E) 查看(V) 收藏(A) 工具(T) 帮助(H)			
地址(1) http://www.businessstime.com.cn/cbt100/top10/stock.htm 转到 链接 >>			
101995	国债995	101996	国债998
111011	中铁963	111012	中铁965
111012	中铁965	111013	中信983
111015	01三峡10	111016	01广核债
111016	01广核债	111017	02电网3
111018	02电网15	111019	02广核债
111019	02广核债	120001	99宝钢债
120101	01中移动	120102	01三峡债

图 1-10 深市部分企业债券代码对照表

3. 可转换公司债券及其代码

可转换公司债券(简称可转换债券)是指发行人依照法定程序发行,在一定期限内依据约定的条件可以转换为股份的公司债券。我国目前挂牌交易的可转换公司债券均是由上市公司发行的可转换债券。

在上交所挂牌交易的可转换债券代码为“100×××”的6位数或以“110”为开头的6位数。具体代码区间为10000×~100×××;11000×~110×××。后面的三位数一般为该可转换债券发行公司的A股股票代码号,如图1-11所示。

在深交所挂牌交易的可转换债券的代码则为“120×××”的6位数,后3位数为该可转换债券发行公司的A股股票代码号,如图1-12所示。

4. 债券回购品种及其代码

债券回购交易是指债券买卖双方成交的同时就约定于未来某一时间以某一价格双方再进行反向交易的行为。目前债券回购品种包括国库券和一部分企业债券。

深交所、上交所的回购业务,最初仅限于国债品种。为了促进交易所债券市

图 1-11 沪市部分可转换债券代码对照表图 1-12 深市部分可转换债券代码对照表



场的发展,完善债券市场机制,为投资者营造更好的市场环境,两个交易所分别于2002年年底和2003年年初推出了企业债券回购品种。能够参与上交所企业债券回购交易的企业债券范围包括:发行规模面值在5亿元人民币以上(含5亿元),期限在3年以上(含3年)的在交易所挂牌的企业债券。

在上交所挂牌的国债回购一共有1天、2天、3天、7天、14天、28天、91天、182天8个回购品种,证券代码为以“201”开头的6位数。

在上交所挂牌的企业债券回购一共有1天、3天、7天3个回购品种,代码分别为202001、202003、202007,如图1-13所示。

股票代码对照表			
200992	ST中鲁B	201000	R003
201000	R003	201001	R007
201002	R014	201003	R028
201003	R028	201004	R091
201005	R182	201006	R273
201006	R273	201007	R004
201008	R001	201009	R002
201009	R002	201010	R004
202001	RC001	202003	RC003
202003	RC003	202007	RC007

图 1-13 沪市部分企业债券回购代码对照表

在深交所挂牌的国债回购一共包括1天、2天、3天、4天、7天、14天、28天、63天、91天、182天、273天11个回购品种。代码为“13××××”的6位数。其中“13”表示国债回购,第3到第6位为顺序编码区,取值范围为0001~9999。目前代码区间为13180×~1318××。

在深交所挂牌的企业债券回购一共包括1天、2天、3天、7天4个回购品种。代码为“13××××”的6位数,其含义与国债回购代码相同。目前具体代码为131900、131901、131910、131911,如图1-14所示。

5. 其他交易品种

(1) 上市型开放式证券投资基金。上市型开放式证券投资基金的英文名称为: Listed Open-end Funds, 简称为 LOFs, 即指在交易所上市交易的开放式证券