

普通高等教育规划教材

# 证券投资实训

主编 孙可娜

副主编 李摇健

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》配套的实训教材。全书以证券投资实务为主线,以网上操作指引为特点,以专业能力训练为目的,对证券投资预备知识、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、网上信息采集等实务内容及操作要领进行了全面介绍。

本书适用于商贸管理类各专业学生在系统学习专业理论的基础上,进行专业实验室实训。同时可广泛用于证券业内的专业训练、有关人员的自助练习、网上证券投资的操作指引等。

## 图书在版编目(CIP)数据

证券投资实训 孙可娜主编 北京:机械工业出版社, 2008  
普通高等教育规划教材  
ISBN 978-7-111-24000-0

I 孙可娜主编 II 孙可娜 III 证券投资—高等学校—教材  
IV 820.62

中国版本图书馆CIP数据核字(2008)第 161000 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:常爱艳 版式设计:霍永明  
责任校对:罗文莉 责任印制:杨庆云  
北京印刷厂印刷·新华书店北京发行所发行  
2008 年 1 月第 1 版第 1 次印刷  
16 开 1 印张·1 千字  
定价:15.00 元

凡购本书,如有缺页、倒页、脱页,由本社发行部调换

本社购书热线电话(010) 68995196

网址:www.cmpbook.com

封面防伪标均为盗版

## 前摇摇言

随着科技的创新与电子信息技术的发展，证券投资方式发生了深刻的变革。不论是投资分析、信息采集还是证券交易，都已经大大摆脱了传统方式的种种局限，变得简单、自助、方便、快捷。借助于网络系统，人们可以随心所欲地观测证券行情、捕捉瞬间变化、采集市场信息、进行大势研判、作出投资选择、完成证券买卖。所有这一切表明，仅仅掌握专业理论是远远不够的，还必须接受系统的专业训练，拥有进行证券投资所必备的各种操作能力。教育的责任不仅在于知识的传递，还在于实现知识向能力的转化。因此，人才培养目标应该注入新的内容，能力的培养应该成为专业课程教学的一个重要组成部分。

从这个意义上说，证券投资课程应该有别于传统的教学模式，在进行理论与实务学习的同时，加强实际操作能力的训练和培养。通过系统的训练与操作，体会和感受理论的意义，同时把知识转化为岗位乃至职业所必需的能力。起跑线上，这应该是体现差别的重要内容。

如何才能使证券投资的理论与实际更好地结合在一起，形成理论与实践的内在联系从而进行严格的系统训练？显然，传统的教学内容和方式面对着挑战，取而代之的，应该是理论学习和实际训练的有机结合。一种能力的形成取决于训练的质量，质量的保证需要建立在严格、规范的基础之上，严格规范的训练不能没有专用的教材。

《证券投资实训》的编写，正是基于这一目的。作为《证券投资教程》的配套部分，《证券投资实训》是专用于学生证券投资专业训练和能力培养的操作指南。该书的特点集中体现在以下方面：

- (员) 系统。对证券投资业务流程进行完整介绍。
- (圆) 规范。符合我国证券投资机构的操作规范。
- (猿) 通用。适用于在校学生、机构和专业人员。
- (源) 简便。图文并茂，便于自主训练和仿真模拟。

全书由以下八部分内容所组成：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。

本书由孙可娜在主编《证券投资教程》的基础上进行总体策划并制定编章结构，由李健负责组织技术资源及有关业务操作资源。具体编写工作分工如下：第一章由孙可娜、刘临娟、徐焕强共同编写，第二章由刘临娟编写，第三章由孙可娜、刘临娟共同编写，第四、五章由刘临娟编写，第六章由李健、刘临娟共同编写，第七章由孙可娜、徐焕强共同编写，第八章由徐焕强编写。全书由孙可娜总纂定稿。

由于编者水平有限，书中缺点、错误在所难免，敬请专家和读者批评指正。联系电话：~~010-68561510~~，电子邮箱：~~zhangyue@163.com~~。  
~~精~~

# 目摇摇录

## 前言

第一章摇证券投资预备知识 .....	员
第一节摇证券交易品种及代码 .....	员
第二节摇证券交易相关规定 .....	圆
第三节摇证券托管登记制度 .....	圆
第二章摇软件下载与安装 .....	圆
第一节摇证券网上交易 .....	圆
第二节摇网上行情查询与软件下载 .....	猿
第三节摇网上交易软件的安装与使用 .....	猿
第三章摇行情分析方法与操作 .....	源
第一节摇大盘分析 .....	源
第二节摇股价指数及走势分析 .....	源
第三节摇证券行情分类报价 .....	缘
第四节摇个股分析 .....	远
第四章摇系统软件功能介绍 .....	苑
第一节摇系统参数设置 .....	苑
第二节摇技术分析参数设置 .....	愿
第三节摇常用工具 .....	愿
第五章摇技术分析方法与应用 .....	怨
第一节摇技术分析的基本原理 .....	怨
第二节摇移动成本分析 .....	员
第三节摇技术指标及其应用 .....	员
第六章摇网上证券委托 .....	员
第一节摇委托设置 .....	员
第二节摇委托买卖 .....	员
第三节摇账户查询 .....	员



第七章 证券投资模拟 .....	员苑
第一节 建立模拟账户 .....	员苑
第二节 模拟交易 .....	员猿
第八章 网上信息采集 .....	员怨
第一节 证券信息采集 .....	员怨
第二节 信息搜索方法 .....	员源
第三节 资讯网站的收藏 .....	员源
附录 .....	圆源
参考文献 .....	圆远

# 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有关知识，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作用。

## 第一节 证券交易品种及代码

目前我国上海证券交易所（以下简称“上交所”）和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的证券品种，主要包括：普通股股票（粤股和月股）；债券（含企业债券、公司债券、可转换公司债券、金融债券及政府债券等）；基金（封闭式基金）；债券回购等以及经证监会批准的其他交易品种。

### 一、股票及其代码

#### 1. 粤股股票代码

粤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、港、澳投资者）以人民币认购和交易的普通股股票。粤股市场于 1990 年成立。

在上交所上市交易的粤股股票交易代码由“730\*\*\*”的远位数组成。代码区间为 730001~730999。图 1-1 为上交所挂牌的部分粤股股票代码对照表。

在深交所上市交易的粤股股票，其交易代码由“000\*\*\*\*”打头的远位数组成。其中“000”表示粤股证券，第 4 到第 7 位为顺序编码区，取值范围为 0001~9999。

1999 年深交所推出中小企业板，其代码为 0020\*\*\*。其中，“002”表示中小企业板块，后 3 位数表示上市顺序。图 1-2 为深市部分粤股股票证券代码对照表。



图 8-1-1



图 8-1-2

## 1. 月股股票代码

月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。

月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。1995年我国开放境内个人居民可以投资月股。

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

在上交所挂牌的月股股票代码为由“900\*\*\*”的远位数组成，其中“900”代表在上交所上市交易的月股股票，具体代码区间为900000~900999，如图1-1所示。

股票代码	股票名称	股票代码	股票名称
900904	永生B股	900905	中信B股
900906	中纺B股	900907	发展B股
900907	发展B股	900908	莱城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	歌华B股
900913	联华B股	900914	精伦B股
900915	ST北久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	大港B股	900922	三毛B股
900922	三毛B股	900923	天迪B股

图1-1 图1-1

在深交所挂牌交易的月股股票代码由“000\*\*\*”的远位数组成。其中“000”表示月股股票，第1到第3位为顺序编码区，取值范围为000000~000999。目前具体代码区间为000000~000999，如图1-2所示。

## 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。



图 10-1-1 股票代码列表

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“~~900000~~”的远位数组成。具体基金代码区间为~~900000~~~~~900099~~,如图 10-1-2 所示。

在深交所挂牌交易的证券投资基金代码由“~~000000~~”的远位数组成。其中“~~0000~~”表示证券投资基金,第 1 到第 4 位为顺序编码区,取值范围为~~0000~~~~~9999~~。目前具体代码区间为~~000000~~~~~000099~~,如图 10-1-3 所示。

Figure 1-1-1: A screenshot of a Microsoft Internet Explorer browser window displaying a table of fund codes and names. The address bar shows the URL: http://www.businessinsider.com.cn/cht100/top10/stock.htm. The table lists various funds with their codes and names.

500008	基金物用	500001	基金普用
500008	基金兴华	500008	基金安博
500009	基金安博	500010	基金金元
500011	基金金鑫	500013	基金安瑞
500013	基金安瑞	500015	基金河兴
500018	基金裕元	500017	基金兴业
500017	基金聚业	500018	基金兴和
500019	基金普博	500021	基金金鼎
500021	基金金鼎	500023	基金双禧
500025	基金兴业	500029	基金科讯
500029	基金科讯	500035	基金源博
500038	基金博乾	500039	基金博瑞
500039	基金博瑞	500056	基金科瑞

图 1-1-1

Figure 1-1-2: A screenshot of a Microsoft Internet Explorer browser window displaying a table of fund codes and names. The address bar shows the URL: http://www.businessinsider.com.cn/cht100/top10/stock.htm. The table lists various funds with their codes and names.

184001	博山基金	184002	天源基金
184002	天耀基金	184003	望天基金
184005	华盈基金	184006	博安受益
184008	博安受益	184501	广发基金
184502	南方基金	184503	广证基金
184503	广证基金	184505	中信基金
184508	省盈基金	184509	广证受益
184509	广证受益	184510	博南博通
184588	基金开元	184589	基金普惠
184589	基金普惠	184590	基金同益
184591	基金聚定	184592	基金裕隆
184592	基金裕隆	184593	基金普华
184595	基金景博	184598	基金裕华

图 1-1-2



### 三、债券及其证券代码

#### 国债及其证券代码

国债是中央人民政府为筹集财政资金而发行的一种政府债券，是中央人民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。

上交所国债现货的证券代码由“00\*\*\*\*”组成，中间 0 位数字为该国债的发行年份，后 0 位数字为其顺序编号；2000 年以前上交所国债现券代码由“00\*\*\*\*”组成，如图 5-5 所示。

代码	名称	代码	名称
009704	97国债(4)	009905	99国债(5)
009908	99国债(8)	010004	00国债(4)
010004	00国债(4)	010010	00国债(10)
010103	01国债(3)	010107	01国债(7)
010107	01国债(7)	010110	01国债(10)
010112	01国债(12)	010115	01国债(15)
010115	01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	06国债(7)
010796	06国债(7)	100001	国债转债

图 5-5 图

深交所国债现券的证券代码由“00\*\*\*\*”组成，中间 0 位数字为该期国债的发行年份，后 0 位数字为其顺序编号，如图 5-6 所示。2000 年十五期以前国债代码为“000000 年号(0 位数) 当年国债发行上市期数(0 位数)”。

#### 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。

在上交所挂牌交易的企业债券代码为“00\*\*\*\*”组成的 0 位数，中间 0 位数字为该债券的上市年份，最后 0 位数字为该债券的上市顺序编号，如图 5-7 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: http://www.businessinsia.com.cn/cb1100/top10/stock.htm

1010756	宝钢转债	100001	南化转债
100009	机场转债	100016	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

Internet

图 10-1 图 10-1 图 10-1

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: http://www.businessinsia.com.cn/cb1100/top10/stock.htm

111016	02厂转债	111017	02电网3
111018	02电网15	111019	02厂转债
111019	02厂转债	120001	09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(5)
120203	02中移(5)	120204	02苏交债
120205	02渝城投	120288	02金茂债
120288	02金茂债	125002	万科转债
125301	茂源转债	125302	茂源转债
125302	茂源转债	125629	钢铁转债
125630	钢铁转债	125729	燕京转债
125729	燕京转债	125998	宝钢转债

Internet

图 10-2 图 10-2 图 10-2



在上交所挂牌交易的金融债券代码为“**01\*\*\*\***”组成的远位数，后源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为“**01\*\*\*\***”的远位数。其中“**01**”表示债券，第**2**到第**4**位为顺序编码区，取值范围为**0001~9999**，如图**1-10**所示。

101995	01国债95	101996	01国债96
111011	中铁983	111012	中铁985
111012	中铁988	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	09宝钢债
120101	01中国移动	120102	01三峡债

图**1-10** 图**1-10**

### 1.1.1 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“**1101\*\*\*\***”的远位数或以“**1101**”为开头的远位数。具体代码区间为**1101001~1101099**；**1101101~1101999**。后面的三位数一般为该可转换债券发行公司的粤股股票代码号，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“**1101\*\*\*\***”组成的远位数，后源位数为该可转换债券发行公司的粤股股票代码号，如图**1-12**所示。

### 1.1.2 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。目前债券回购券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 2004 年年底和 2005 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 1 亿元以上（含 1 亿元），期限在 1 年以上（含 1 年）的在交易所挂牌的企业债券。

股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer			
010307	010307	010795	010795
010796	010796	100001	100001
100008	100008	100016	100016
100016	100016	100057	100057
100115	100115	100117	100117
100117	100117	100177	100177
100203	100203	100210	100210
100210	100210	100213	100213
100214	100214	100215	100215
100215	100215	100220	100220
100226	100226	100301	100301
100301	100301	100303	100303
100307	100307	100527	100527
100527	100527	100726	100726
100795	100795	101903	101903

图 1-1-1 股票代码对照表

在上交所挂牌的国债回购一共有 1 天、2 天、3 天、4 天、5 天、6 天、7 天、8 天、9 天等 9 个国债回购品种，证券代码分别为以“0103”开头的 4 位数。

在上交所挂牌的企业债券回购一共有 1 天、3 天、4 天等 3 个回购品种，代码分别为 010307、010308、010309，如图 1-1-2 所示。

在深交所挂牌的国债回购一共包括 1 天、2 天、3 天、4 天、5 天、6 天、7 天、8 天、9 天、10 天、12 天、15 天、18 天、21 天、24 天、27 天、30 天等 18 个回购品种。由代码为“0193\*\*\*\*”的 4 位数组成。其中“0193”表示国债回购，第 3 到第 4 位为顺序编码区，取值范围为 001~999。目前代码区间为 0193001~0193999。

在深交所挂牌的企业债券回购一共包括 1 天、2 天、3 天、4 天等 4 个回购品种。代码为“0193\*\*\*\*”，其含义与国债回购代码相同。目前具体代码为 0193001、0193002、0193003、0193004，如图 1-1-3 所示。

The screenshot shows a Microsoft Internet Explorer browser window displaying a table of stock codes and names. The address bar shows the URL: http://www.businessinsider.com.cn/cbt100/top10/stock.htm. The table contains 20 rows of data, each with a stock code, a name, and another code. The names include various types of bonds and special shares.

111019	02广债债	120001	99宝药债
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	120206	02金茂债
120288	02金茂债	125002	万科转债
125301	比亚迪转债	125302	茂硕转债
125302	沃旭转债	125629	顺凯转债
125630	网都转债	125729	德宏转债
125729	德宏转债	125992	嘉钢转债
125930	南原转债	125936	华西转债
125936	华西转债	126301	丝路转债
126801	65石化债	126701	96三峡债
126701	66三峡债	126702	96石化债
126703	66梅山债	126801	67国电债
126801	67国电债	126802	67中铁3
126803	67中铁5	126804	66三峡3
126804	66三峡3	126805	66三峡8
126806	68中铁(1)	126901	98中铁(2)
126901	98中铁(2)	126902	98中铁(1)
126903	96三峡债	126904	96中债(1)

图 10-1-1 图 10-1-1

### 其他交易品种

(员) 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-Ended Fund，简称 LOF，即指在交易所上市交易的开放式证券投资基金。同时拥有证券交易所场内集中交易和场外认购、申购、赎回两种交易方式。中国证监会批准深交所推出上市型开放式基金。

LOF的特点是投资者既可以通过基金管理人或其委托的销售机构以基金净值进行基金的申购、赎回，也可以通过交易所市场以交易系统撮合成交价进行基金的买入、卖出。

深交所推出的首只 LOF 为南方基金管理公司管理的南方积极配置证券投资基金。



股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

地址: http://www.businesschina.com.cn/cbt100/top10/stock.htm

200992	ST中集B	201000	8003
201000	8003	201001	8007
201002	8014	201003	8026
201003	8028	201004	8091
201005	8182	201006	8273
201006	8273	201007	8004
201008	8001	201009	8002
201009	8002	201010	8004
202001	8C001	202003	8C003
202003	8C003	202007	8C007

图 1-1-1 图 1-1-1



股票代码对照表 - Microsoft Internet Explorer

地址: http://www.businesschina.com.cn/cbt100/top10/stock.htm

131803	B-028	131804	B-053
131804	B-053	131805	B-091
131806	B-182	131807	B-273
131807	B-273	131809	B-004
131810	B-001	131811	B-002
131811	B-002	131900	8C-003
131901	8C-007	131910	8C-001
131910	8C-001	131911	8C-002

图 1-1-2 图 1-1-2

(圆) 交易型开放式指数基金。交易型开放式指数基金的英文名称为：跟踪标的指数证券投资基金，简称 基金，又称“交易所交易基金”。基金是一种跟踪“标的指数”变化、且在证券交易所上市交易的基金。投资人可以如买卖股票那么简单地去买卖跟踪“标的指数”的基金，并使其可以获得与该指数基本相同的