

<<现代投资组合理论和投资分析>>

图书基本信息

书名：<<现代投资组合理论和投资分析>>

13位ISBN编号：9787300068275

10位ISBN编号：7300068278

出版时间：2006-1

出版时间：人民大学

作者：[美]埃德温·J·埃尔顿等

页数：797

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

<<现代投资组合理论和投资分析>>

内容概要

本书是一本介绍现代投资理论和组合管理的教材，适用于组合管理，投资分析，证券分析等课程的本科和研究生。

本书既包括了对单个证券的分析，也涵盖了优化组合证券选择问题。

主要涉及到对金融市场和证券的介绍，对资本资产定价模型和套利定价的介绍，对国际基金表现的分析，对债券管理的分析，以及对组合评价的多级模型的探讨，此外，本书还介绍了许多现代投资理论的前言观点。

本书作为投资组合理论课程和偏重组合理论的投资分析课程的教材，我们已在纽约大学进行了多年的实践。

对组合分析课程来说，书中充分地向学生介绍了现代投资组合理论和一般均衡模型（资本资产定价模型和套利定价模型）。

本书也将对从业的证券分析师和组合经理人有所帮助。

现代投资组合理论应用到投资实践中的速度令人惊异。

投资经理人如果希望较全面地了解现代投资组合理论和投资分析，本书部分章节介绍了这些问题，且易于读懂。

那些关注应用的专家将会发现为他们提供了最为现代的工具。

如何设计出受到投资者青睐的投资组合？

国际分散化的投资组合究竟有哪些益处？

投资组合与构成组合的证券之间的关系究竟如何？

对于上述问题，你将在这本新的《现代投资组合理论和投资分析》（第六版）中找到解答，并能发现更多的内容。

在这一版中，埃德温·埃尔顿和马丁·格鲁伯与新加入的作者斯蒂芬·布朗和威廉姆·戈茨曼一起，深入浅出地为我们展示了最新的投资分析和组合管理的先进理论和技术。

本书在简要介绍证券与市场的基本概念之后，一步步引导读者了解现代投资组合理论的内涵，包括其强势和弱点以及近年来取得的突破。

随着内容的一步展开，你将了解如何评价单个证券，如何将证券构成表现优异的投资组合，以及如何应用诸如均衡理论的现代工具来更有效的管理组合。

<<现代投资组合理论和投资分析>>

作者简介

埃德温·J·埃尔顿(Edwin J. Elton)是纽约大学斯特恩商学院的野村金融学教授。

他共独立或与他人合作出版了8本书并发表了90余篇论文。

这些论文主要发表在如The Journal of Finance, The Review of Financial Studies, Review of Economics and Statistics, Management Science, Journal of Financial Economics, Journal of Business, Oxford Economic Papers, Journal of Financial and Quantitative Analysis等著名刊物上。

他一直担任《金融期刊》(The Journal of Finance)的联合编辑。

埃尔顿教授一直是美国金融学会(American Finance Association)董事会的成员,《管理科学》(Management Science)杂志的副编辑。

他现在担任《金融与银行》(Journal of Banking and Finance)以及(Journal of Accounting, Auditing and Finance)的副编辑。

埃尔顿教授为很多大型金融机构担任咨询顾问。

最近麻省理工学院出版社为埃尔顿教授与格鲁伯教授出版了两卷本的论文集。

埃尔顿教授曾任美国金融学会主席,是该学会的成员,也是东部金融学会出色研究奖的获得者。

<<现代投资组合理论和投资分析>>

书籍目录

第1部分 导论 第1章 导论 第2章 金融证券 第3章 金融市场第2部分 组合分析 第1篇 均值方差组合理论 第4章 风险条件下机会集的特征 第5章 描述有效投资组合 第6章 计算有效边界的技术 第2篇 简化组合选择过程 第7章 证券收益之间的相关结构：单指数模型 第8章 证券收益之间的相关结构：多指数模型和分组技术 第9章 确定有效边界的简单技术 第3篇 选择最优组合 第10章 效用分析 第11章 其他组合选择模型 第4篇 扩展选择空间 第12章 国际分散化第3部分 资本市场均衡模型 第13章 标准型资本资产定价模型 第14章 非标准型资本资产定价模型 第15章 对均衡模型的实证检验 第16章 套利定价模型——解释资产价格的一种新方法第4部分 证券分析和投资组合理论 第17章 有效市场 第18章 估值过程 第19章 盈利估计 第20章 利率理论和债券定价 第21章 债券组合管理 第22章 期权定价理论 第23章 金融期货的定价与使用 第5部分 评价投资过程 第24章 评价组合业绩 第25章 评价证券分析 第26章 投资组合管理——回顾参考文献索引

<<现代投资组合理论和投资分析>>

编辑推荐

如何设计出受到投资者青睐的投资组合？

国际分散化的投资组合究竟有哪些益处？

投资组合与构成组合的证券之间的关系究竟如何？

对于上述问题，你将在这本新的《现代投资组合理论和投资分析》（第6版）中找到解答，并能发现更多的内容。

在这一版中，埃德温·埃尔顿和马丁·格鲁伯与新加入的作者斯蒂芬·布朗和威廉姆·戈茨曼一起，深入浅出地为我们展示了最新的投资分析和组合管理的先进理论和技术。

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>