

<<投资风险管理>>

图书基本信息

书名：<<投资风险管理>>

13位ISBN编号：9787302225379

10位ISBN编号：7302225370

出版时间：2010-6

出版时间：清华大学出版社

作者：迟国泰

页数：203

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>

## 前言

管理教育和人才培养的各种制度中，工商管理硕士（MBA）制度是一项行之有效、富有成果的制度，它培养的是高质量的、处于领导地位的职业工商管理人才。

工商管理硕士教育传授的是面对实战的管理知识和管理经验，而不是侧重理论研究；注重复合型、综合型人才培养，重视能力培养。

在发达国家其已经成为培养高级企业管理人才的主要方式。

我国正式开始引进工商管理硕士学位制度始于1984年。

但是早在1980年，按照1979年邓小平同志访美期间向当时的美国总统卡特提出由美方派遣管理教育专家来华培训我国企业管理干部的要求，中国和美国两国政府成立了坐落在大连理工大学的“中国工业科技管理大连培训中心”。

在开始的几年内，办起了学制为8个月的厂长经理讲习班，其教学内容是按照MBA教育的框架“具体而微”地设计的，并开设了MBA教育中所有的核心课程。

这种培训教育曾被认为是“袖珍型MBA”，这可以说是MBA理念引入我国的开始。

1984年开始，根据中美两国有关合作进行高级管理人员的第二个五年的协议，由中国的大连理工大学与美国布法罗纽约州立大学合作开办三年制的MBA班，这是对我国兴办MBA教育的一次试点。与此同时，培训中心将美国教授在大连讲学的记录整理出版了一套现代企业管理系列教材，原来共9种，后来扩展为13种，这套教材由企业管理出版社出版，发行超过百万册，填补了当时缺乏面向实际应用类型教材的空白，也为后来的MBA教材建设奠定了一个基础。

我国从1991年开始，正式开办MBA专业学位教育。

在经过10多年的实践和摸索之后，中国的MBA教育已经进入一个新的发展时期，目前中国拥有MBA招生和培养资格的院校已经有100余所。

这种专业学位的设置使我国的学位制度更趋完善，推动了我国高级专门人才培养的多样化，使学位制度进一步适应科学技术事业和经济建设发展的需要。

MBA教育需要适合面对实战的管理知识和管理经验的教材。

## <<投资风险管理>>

### 内容概要

本书包括金融市场与投资环境、投资理论、债券市场和债券投资、股票与基金、远期和期货、期权分析与投资等6章内容。

本书的基本内容涵盖了资本和资产的配置理论与方法，突出了资产估值、资产优化和风险管理。

本书的主要特色，一是传递资本和资产配置效率的金融理论的核心信息；二是通过远期、期货、期权的套期保值功能满足企业实践中的风险管理需求；三是通过对资产估值、资产优化和风险管理的阐述使教材内容与国际惯例接轨；四是通过有关章节后由金融模型严谨推导的附录使有精力的读者深入了解典型金融模型的来龙去脉；五是通过案例和实例使读者掌握并能初步运用资产估值、资产配置和风险管理等金融学的主要精髓和核心知识。

本书读者对象为普通高校工商管理类本科生和研究生，特别是MBA学生，也可供金融、证券类行业从业人员参考使用。

## 作者简介

迟国泰博士，大连理工大学管理学院教授，博士生导师。  
大连理工大学“金融风险管理与科学评价”科研创新团队负责人，大连理工大学金融风险与系统评价管理研究中心主任。  
主要研究方向为商业银行风险管理决策理论与模型，期货交易风险管理决策理论与模型。  
主持国家社会科学基金重大项目和一般项目各1项，主持国家自然科学基金项目6项。

## &lt;&lt;投资风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 金融市场与投资环境	1.1 投资和投资管理概述	1.1.1 投资与投资的适宜性	1.1.2 投资管理的过程	1.1.3 生命周期与投资目标	1.1.4 经济周期与投资管理	1.1.5 投资的风险与收益
1.2 投资工具概览	1.2.1 现金及现金等价物	1.2.2 固定收益投资工具	1.2.3 股权投资工具	1.2.4 基金投资工具	1.2.5 期货	1.2.6 外汇投资工具
1.2.7 房地产	1.2.8 实物及其他投资工具	1.3 金融及金融系统概述	1.3.1 金融三大理论支柱	1.3.2 什么是金融系统	1.3.3 宏观经济中的资金流动	1.3.4 金融系统三大核心机构
1.3.5 金融系统的功能	案例1.1 开设一家公司面临的风险	案例1.2 企业年金出售中的逆向选择	1.4 金融市场的价格	1.4.1 利率	1.4.2 汇率	1.4.3 股票价格指数
1.5 投资信息	1.5.1 信息渠道	1.5.2 上市公司提供的信息	习题	第2章 投资理论	2.1 单一资产收益与风险	2.1.1 收益的类型与测定
2.1.2 风险的类型与测定	2.2 资产组合理论	2.2.1 资产组合的收益与风险	案例2.1 两种证券构造的资产组合的收益与风险	2.2.2 效用函数及应用	2.2.3 有效集与投资者的选择	2.2.4 风险资产与无风险资产的配置
案例2.2 两个风险资产和一个无风险资产的最优投资组合	案例2.3 长者的投资组合	2.3 资本资产定价模型	2.3.1 资本资产定价模型和证券市场线	2.3.2 $\alpha$ 系数	2.3.3 市场模型对风险的分解	2.3.4 投资分散化的解释
2.3.5 CAPM的局限, 陆	2.4 套利定价理论	2.4.1 套利的概念及基本形式	2.4.2 无风险套利的定价机理	2.4.3 套利投资组合	2.4.4 套利定价理论	2.4.5 套利定价模型检验
2.4.6 APT与CAPM的比较	2.4.7 套利定价理论的应用	2.5 市场有效性	2.5.1 市场有效性的定义与分类	2.5.2 投资策略与市场有效性	2.5.3 异象	2.5.4 市场有效性的实证检验
案例2.4 市场有效性与意外事件的影响	习题	附录2.A 风险的价格与效用函数的保费	附录2.B 最小方差资产组合的推导	附录2.C 资本资产定价模型的推导	第3章 债务市场和债务投资	第4章 股票与基金
第5章 远期与期货	第6章 期权分析与投资	参考文献	后记			

## 章节摘录

5.证券市场线与资本市场线的比较 (1) 证券市场线 (SML) 与资本市场线 (CML) 都是描述资产或资产组合的期望收益率与风险之间关系的曲线。

(2) CML是由所有风险资产与无风险资产构成的有效资产组合的集合,反映的是有效资产组合的期望收益率与风险程度之间的关系。

CML上的每一点都是一个有效资产组合,其中M是由全部风险资产构成的市场组合,线上各点是由市场组合与无风险资产构成的资产组合。

(3) SML反映的则是单项资产或任意资产组合的期望收益与风险程度之间的关系。

(4) CML是由市场证券组合与无风险资产构成的,它所反映的是这些资产组合的期望收益与其全部风险间的依赖关系。

(5) SML是由任意单项资产或资产组合构成的,但它只反映这些资产或资产组合的期望收益与其所含的系统风险的关系,而不是全部风险的关系。

因此,它用来衡量资产或资产组合所含的系统风险的大小。

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>