第一图书网, tushu007.com

<<投资组合管理>>

图书基本信息

书名：<<投资组合管理>>

13位ISBN编号：9787505866867

10位ISBN编号：7505866869

出版时间：2007-12

出版时间：经济科学

作者：齐岳

页数：235

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

内容概要

本书汇集了笔者有关投资组合管理的最新研究成果，在基于笔者近年来在国际期刊和国际会议上发表和报告的20余篇论文上，阐述了以共同基金为代表的大规模投资组合的研究突破以及投资组合管理的前沿——多目标投资组合。
全书共分8个章节，具体内容包括投资组合管理概述、产生协方差矩阵、投资组合管理的突破、多目标投资组合管理等。
该书内容专深，而且体现了投资组合理论的最新进展，它可供投资组合理论和投资组合管理方向的高年级本科生和研究生以及相应的从业人员使用。

第一图书网, tushu007.com

作者简介

齐岳博士：2004年毕业于著名的美国佐治亚大学(The University of Georgia)泰瑞商学院金融学与银行学系。
该校是美国第一所州立大学并成为美国公立高等教育的诞生地。
其商学院被公认为美国最好的商学院之一。
齐岳博士曾在著名的国际期刊金融决策杂志(Journal of Financial Decision Making)和国际学术会议例如金融管理学会(Finarlcial Management Associa tion Internafional)年会上发表与报告20余篇论文。
齐岳博士曾任摩纳哥国际大学金融学教授、研究员、博士生导师。
2007年10月，作为南开大学引进人才，现任南开大学商学院教授。
齐岳教授在佐治亚大学和摩纳哥国际大学讲授过金融学的核心课程，包括投资组合理论与管理、金融数学等。

<<投资组合管理>>

书籍目录

前言第一篇 引论　第一章 引言　　第一节 投资组合理论的辉煌成就　　第二节 尚待解决的问题　第三节 多目标投资组合　　第四节 本书结构　第二章 投资组合管理概述　　第一节 回报率和风险　　第二节 投资组合的数学背景　　第三节 投资组合选择　　第四节 其他投资组合选择和管理模型第二篇 投资组合管理的突破　第三章 产生协方差矩阵　　第一节 源起　　第二节 产生真实的数据　第三节 评估所产生的协方差矩阵　　第四节 计算经验和应用　第四章 计算有效边界　　第一节 常用方法　　第二节 关键线算法　　第三节 Hirschberger、Qi和Stcuer算法　　第四节 附录：多目标优化　第五章 投资组合管理的突破　　第一节 投资组合优化的突破　　第二节 去除投资组合优化的简化模型的必要性　　第三节 有效和多样化的互斥性的最新审视　　第四节 深入研究有效边界的敏感度　　第五节 确定有效边界的切点投资组合第三篇 投资组合管理的创新　第六章 多目标投资组合管理　　第一节 多目标投资组合管理概论　　第二节 与传统投资组合管理的联系　　第三节 被埋藏的市场投资组合　　第四节 论证多目标投资组合选择　　第五节 传统投资组合理论的困境　　第六节 投资目标函数的确定　第七章 计算有效曲面　　第一节 回顾传统模型　　第二节 计算最小方差曲面　第三节 证明最小方差曲面为抛物面　　第四节 计算有效曲面　　第五节 投影回到传统模型与市场投资组合的有效性　　第六节 k目标投资组合选择模型　第八章 展望参考文献

章节摘录

第一章　引言　　我们在本章回顾投资组合理论的辉煌成就，同时也指出一些有待解决的问题。提出解决的方向并加以实现在一定意义上构成了投资组合管理的最新突破。
我们同时也探讨投资组合管理的一个前沿研究课题——多目标投资组合，并勾勒了本书的结构。
　　第一节　投资组合理论的辉煌成就　　诺贝尔经济学奖得主Markowitz（1952）提出的投资组合理论被广泛地公认为现代金融理论的开端。
Markowitz的理论已经广泛被各大金融机构用于建立和衡量它们的投资组合。
此理论并被不断地推广和提升，甚至被用于普通投资者的投资组合管理。
此理论还进一步成为资产定价理论的基础。
Rubin—stein（2002）在Markowitz（1952）的论文发表50年之际系统地回顾此理论的贡献。
　　随着Markowitz拉开序幕，大量关于投资组合管理的经典著作随之涌现。
Markowitz（1959）完整地阐述了孕育于他的博士论文和l952年论文中的投资组合理论。
Markowitz和Todd（2000）系统地论证了有效边界由一些拐点投资组合构建，两个相邻的拐点投资组合之间的有效边界片段是双曲线片段。
他们进一步描述了Markowitz（1956）提出的关键线算法来求解精确的有效边界。
基于Markowitz（1952）的投资组合理论，Sharpe（2000）全面阐述了Sharpe（1964）的资产定价模型。他的模型成为现代金融理论的核心之一。
Ehon、Gruber、Brown和Goetzmann（2007）、Reilly和Brown（2006）、Chinca—rini和Kim（2006）、Grinold和Kahn（2000）以及Farrell，Jr.　（1997）详细论述了投资组合管理的方方面面，诸如投资组合分析、资本市场的均衡、证券分析研究和投资组合理论、投资过程评估。

第一图书网, tushu007.com

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