

<<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：9787509523339

10位ISBN编号：7509523338

出版时间：2010-8

出版时间：中国财政经济出版社

作者：李志生 编

页数：278

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>

## <<投资组合管理>>

### 内容概要

投资组合管理是金融市场上各类投资活动的核心自20世纪50年代美国学者马柯威茨（Henry M . Markowitz）提出资产组合理论以来。

现代投资组合管理理论获得了长足的发展，已经成为现代金融学和投资学理论的基础。

在金融市场投资决策和风险管理实践中具有十分重要的地位。

因此。

对现代投资组合理论进行系统学习，全面理解和掌握该学科的基础理论和基本技术方法，是投资理财专业学生对相关专业知识和研究工作的共同需要。

根据全国高等教育自学考试教材编写的要求。

我们组织在投资组合和风险管理领域具有丰富教学、科研和实践工作经验的教师编写《投资与理财系列教材·投资组合管理》一书。

《投资与理财系列教材·投资组合管理》系统而简洁地介绍了投资组合管理领域的基础理论和最新发展。

在编写过程中。

我们参考了国内外大量投资组合管理理论与实践的书籍和文献资料力求以平实、简洁的语言来描述成熟的理论和观点。

在论述原理的基础上注重应用和实践。

同时体现现代投资组合理论的最新进展。

除了作为全国高等教育自学考试投资理财专业教材外。

《投资与理财系列教材·投资组合管理》还可作为大专院校相关专业和投资理财从业人员的参考书。

## &lt;&lt;投资组合管理&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 金融市场与金融工具第一节 金融市场和参与者第二节 基础金融市场工具第三节 金融衍生工具第二章 收益和风险第一节 投资收益的度量第二节 投资收益的风险第三节 风险和收益的关系第三章 投资组合决策第一节 投资的生命周期第二节 资产配置决策第三节 投资决策的流程第四章 马柯威茨资产组合理论第一节 有效市场第二节 均值方差模型第三节 均值方差模型的扩展第五章 资产定价理论第一节 风险—收益的单因素模型第二节 风险—收益的多因素模型第三节 资产定价理论的评析第六章 跨期资产组合第一节 跨期资产组合概述第二节 多期资产组合分析方法第三节 跨期资产组合模型第七章 投资组合中的决策者行为第一节 投资组合决策者中的行为偏好与决策偏差第二节 行为组合理论第三节 下方保护和上方期望的财富配置模型第八章 证券分析和组合管理第一节 债券组合管理第二节 股票组合管理第三节 金融衍生工具在投资组合中的运用第九章 投资组合评价第一节 单因素绩效评价方法第二节 多因素绩效评价方法第三节 基于择时和选股能力的评价方法第四节 基于风险价值 (VaR) 的投资组合评价方法

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>