

<<个人投资策略指南>>

图书基本信息

书名：<<个人投资策略指南>>

13位ISBN编号：9787561354018

10位ISBN编号：7561354010

出版时间：2011-7

出版时间：陕西师范大学出版总社有限公司

作者：彼得·斯坦叶

页数：246

译者：张璐

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>

## <<个人投资策略指南>>

### 内容概要

《个人投资策略指南(第2版)》基于详细的分析，向人们勾勒出个体投资者该如何进行恰当的投资策略安排。

本书在强调了行为分析和传统金融原则的重要性的同时，还探讨了投资者目标和习惯性错误等方面研究的新进展。

在复杂投资理念风行的时候，第一版的《个人投资策略指南》强调了传统的“保持简单”的投资策略的重要性。

它认为政府债券在风险管理中起到了标杆的作用，并提出要重视投资变得复杂之后产生的潜在流动性风险，同时揭示了具有较低波动性的对冲基金策略中蕴含的风险。

第二版进行了深入的内容修订和延伸，更新了大量的图表，但是它的主题思想未变：大部分的投资者是为了长期储蓄而不是短期投资，于是，政府债券而非现金为投资者提供了避险地；股票并不仅仅是获取回报的风险资产；另类投资比较复杂而且是不透明的，发掘投资机会的投资技巧也是比较难得的。

本书由彼得·斯坦叶著，张璐译。

## <<个人投资策略指南>>

### 书籍目录

#### 第一部分整体介绍

##### 第1章准备工作

金融骗局：“一个长期的话题”

其他灾难性的投资

三思而行

你能承受多大的风险？

知道你的投资机会

战争箱和保护伞

专栏：基础货币(本位币)

##### 第2章了解你的行为

来自行为金融学的观点

投资者偏见

投资者偏好

损失厌恶

心理账户和行为投资组合理论

投资策略和行为金融学

参数不确定性和行为金融学

传统金融学、行为金融学及其演化

##### 第3章市场投资收益：市场会让我富裕起来吗？

投资业绩来源

提供不同保护的避风港

哪类政府债券业绩最佳？

—专栏：盈亏平衡通货膨胀率是市场的预测吗？

投资者期望获得什么样的溢价收益？

股权风险溢价

股权风险：不要寄希望于时间来分散风险

##### 第4章我们该怎么做：买进并持有还是视市场而定？

模型投资策略

坚持市场信念与避险港投资

专栏：市场泡沫

策略模型的恰当角色

##### 第5章时间期限和策略特点：简单持有

短期投资策略

现金的安全性如何？

没有完全适用的短期策略

专栏：债券为短期投资者提供保险了吗？

你对长期投资感兴趣吗？

## <<个人投资策略指南>>

个人和机构财富的投资年限

长期投资者

理财规划和投资期限

“避险资产”、基准、风险承受和长期策略

“简单持有”的危险

好的和坏的波动性

专栏：未预期到的通胀：再次扫大家的兴

“简单持有”的长期资产配置模型

长期投资者应该持有更多的股票吗？

再一次发生通货膨胀

阶梯政府债券：一个以“安全第一”的有用投资组合

债券梯、税收和信誉：美国市政债券的案例

专栏：奥兰治县的传奇故事：什么是优质的市政债券？

采取长期战略存在着什么陷阱吗？

长期养老金储蓄和风险厌恶程度

长期策略：“不完全信息改变了一切”

市场时机：无法避免的风险

一些“简单持有”策略得出的信息

专栏：出现坏结果的机率可能比你想象的要高

第二部分实施更加复杂的战略

第6章准备工作

有益的提醒：流动性风险

行为金融，市场效率和套利机会

套利的障碍

根本性风险和套利

羊群效应和套利

实施成本、市场发展和套利

机构财富和个人财富：税收

第7章股票

个人投资组合中集中的股票头寸

企业主管薪酬计划

股票市场的不安全特性

股票市场异常及资本资产定价模型的基本见解

“小盘股”和“大盘股”

不要因为你的“风格”而忘乎所以

一专栏：价值型和成长型理财经理

谨慎投资者应该高估价值型股票吗？

股票红利和谨慎的投资者

偏好国内投资：国际投资价值多少？

是否应对国际权益投资进行套期保值？

## <<个人投资策略指南>>

国际权益投资和流动性风险

第8章信用

信用质量和信用评级机构

组合分散化与信用风险

专栏：本国货币标价的新兴市场债券

证券化，投资债券市场的现代方法和信用紧缩

按揭贷款支持证券

专栏：按揭贷款支持证券在实现投资目标中的作用

资产支持证券和担保债务权证

国际债券和货币对冲

它是如何实现的？

它的成本是什么呢？

怎样进行外汇预测？

第9章对冲基金

什么是对冲基金？

系统性回报和风险的其他来源

“对冲基金真能实现对冲吗？”

”

对冲基金收益数据的质量

如何激励对冲基金管理者？

对冲基金费用是否过高？

投资技巧对于对冲基金回报的重要性

对冲基金策略的种类

对冲基金市场的规模

直接策略

权益对冲、多空策略和权益市场中性策略

卖空和偏好短头寸的管理者

“只做多头”的权益对冲基金

新兴市场对冲基金

固定收益对冲基金：廉价债券

套利策略

固定收益套利

兼并套利

可转换套利

统计套利

多策略基金

商品交易顾问或管理型期货基金

对冲基金的风险

操作风险

低流动性对冲基金投资和长通知期问题

谎言，该死的谎言与对冲基金风险数据

## <<个人投资策略指南>>

“完美风暴”与对冲基金风险

管理投资者风险：对冲基金的基金作用  
你应该为配置你的对冲基金支付多少费用？

问卷：对你的对冲基金经理者提问  
对你的对冲基金经理者提问  
对你的对冲基金顾问提问  
对你的对冲基金的基金经理者提问  
第10章私募股权——信息导向的投资回报  
什么是私募股权？

私募股权市场风险  
上市私人股本  
私募股权组合  
私募股权投资回报  
专栏：私人投资、成功交易和估值偏见  
第11章房地产市场  
什么是房地产投资？

专栏：使用金融衍生品投资于房地产市场  
投资房地产的吸引力有哪些？

多样化  
专栏：现代房地产指数以及评估房地产的多样化角色  
收益率  
通胀对冲  
房地产投资的风格以及主动投资管理机会  
什么是不动产价值以及你应当期望多少的收益  
租金收入  
作为房地产投资基准的政府债券收益  
租客信用风险  
房产报废  
房地产私募和公募市场  
房地产市场的国际多样化  
汇率风险以及国际房地产投资  
第12章艺术和收藏品市场  
艺术品市场价格的驱动因素  
专栏：艺术品市场指数  
投资于艺术品  
其他激情型投资  
附录1  
附录2  
附录3

<<个人投资策略指南>>

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>