

<<现代投资管理一种均衡方法>>

图书基本信息

书名：<<现代投资管理一种均衡方法>>

13位ISBN编号：9787300083391

10位ISBN编号：7300083390

出版时间：2007-10

出版时间：中国人民大学出版社

作者：鲍勃·李特曼和高盛资产管理公司定量资源小组

页数：543

译者：香港雷尼国际出版有限公司

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>

<<现代投资管理一种均衡方法>>

内容概要

本书概括了高盛资产管理公司定量资源小组为了实现有利的和一致性的收益所使用的现代投资理论。

通过深刻的分析和专家的建议，你将学到一个均衡的框架，能够帮助你构建期望收益最大交东路风险预算约束的资产组合，以及学会如何识别均衡和利用偏离均衡的机会。

全书共分6部分：第一部分对过去学术机构已经建立的投资管理原理进行一些简单和实际的介绍；第二部分关注最大的机构资产组合所面临的问题；第三部分从定义风险预算到协方差矩阵的估计等不同方面来讨论风险；第四部分着眼于诸如股票和债券等传统资产类别，以及经理人选择所面临的挑战；第五部分考虑诸如货币、其他覆盖（overlay）、套期保值基金、私人股票战略等非传统投资；第六部分探索私人投资者的特殊问题，诸如税收考虑、不动产计划。

<<现代投资管理一种均衡方法>>

作者简介

安德鲁·奥尔福德（Andrew Alford），副主席，领导全球定量股票研究（GQE）团队进行基础定量投资战略研究。

他也是GQE投资政策委员会的成员。

在加入高盛资产管理公司（GSAM）以前，他是宾夕法尼亚大学沃顿商学院以及麻省理工学院斯隆管理学的教授。

奥尔福也曾是华盛顿证券和交易委员会经济办公室的学术成员。

他的文章曾发表在《公司理财杂志》、（Journal of Corporate）《会计研究杂志》（Journal of Accounting Re-search）、《会计与经济杂志》（Journal of Accounting & Economics）和，《会计学回顾》（Accounting Review）上。

奥尔福德在加利福尼亚大学的埃尔文学院（Irvine）获得信息与计算机科学学士学位（1984），在芝加哥大学商业研究生院获得工商管理硕士（MBA）和博士学位（1986年和1990年）。

<<现代投资管理一种均衡方法>>

书籍目录

第一部分 理论第1章 导论：为什么是一种均衡方法第2章 现代投资组合理论的洞察力第3章 风险度量第4章 资本资产定价模型第5章 股票风险溢价第6章 全球均衡预期收益第7章 超越均衡——布莱克 - 李特曼方法第二部分 机构基金第8章 市场组合第9章 战略资产分配中的问题第10章 有不确定负债的战略资产分配第11章 国际化分散与货币套期保值第12章 不相关回报来源价值第三部分 风险预算编制第13章 建立最优积极风险预算第14章 根据积极风险系列编制风险预算第15章 风险管理和总基金水平的风险预算第16章 协方差矩阵估计第17章 风险监控和绩效度量第18章 独立估价的需要第19章 收效归属第20章 证券风险因子模型第四部分 传统投资第21章 经理人选择的资产管理方法第22章 投资计划的实施：现实和最好的实践第23章 股票组合管理第24章 固定收益证券的风险和收益第五部分 可转换资产类别第25章 全球战术资产配置第26章 战略资产配置和对冲基金第27章 对冲基金资产组合管理第28章 私有股投资第六部分 私有财产第29章 实际税后投资第30章 1926-2001年，美国股票、债券和国库券的实际税后回报第31章 资产配置和定位第32章 股票资产组合结构

<<现代投资管理一种均衡方法>>

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>