

<<投资分析与组合管理>>

图书基本信息

书名：<<投资分析与组合管理>>

13位ISBN编号：9787300131535

10位ISBN编号：7300131530

出版时间：2011-3

出版时间：中国人民大学出版社

作者：弗兰克·K·赖利,基思·C·布朗

译者：李伟平

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>

<<投资分析与组合管理>>

内容概要

本书旨在帮助读者学会如何管理自己的财富，以从中实现收益最大化。

本书一方面对资本市场的运行机制和可供选择的投资工具等内容，进行了清晰易·瞳的现实描述；一方面对如何通过评估投资目标和机会来建立符合个人风险—收益偏好的投资组合，进行了深入浅出的理论分析。

此外，本书还系统探讨了日新月异的全球化趋势对投资理论和实践的影响。

本书采用的资料力求严谨，强调实证方法的运用，但避免过于数量化。

赖利和布朗两位作者提供了一本优秀的投资分析与组合管理教材，并已被世界各地的专业人士、机构和学校广泛使用。

对于那些希望全面了解和深入学习投资理论与实践的读者而言，本书是一个绝佳的选择。

<<投资分析与组合管理>>

作者简介

弗兰克·K·赖利(Frank K. Reilly)

圣母大学贝尔纳·J·汉克(Bernard

J. Hank)学院的金融学教授，曾担任圣母大学Mendoza商学院院长。

赖利教授先后获得圣母大学工商管理学士学位(BBA)、西北大学工商管理学硕士学位(MBA)和芝加哥大学博士学位(Ph. D.)。

赖利教授曾先后执教于伊利诺伊大学、堪萨斯大学、怀俄明州立大学和圣母大学。

赖利教授拥有数年担任资深证券分析师的经历和从事股票债券交易的丰富经验。

<<投资分析与组合管理>>

书籍目录

上册

第一部分 投资背景知识

- 第1章 投资环境设定
- 第2章 资产配置决策
- 第3章 在全球市场选择投资工具
- 第4章 证券市场的组织与运作
- 第5章 证券市场指数

第二部分 投资理论的发展

- 第6章 有效资本市场
- 第7章 资产组合管理导论
- 第8章 资产定价模型导论
- 第9章 风险与收益率的多因子模型

第三部分 估值原理与实践

- 第10章 财务报表分析
- 第11章 证券估值导论

第四部分 普通股股票的分析与管理

- 第12章 股票市场的宏观分析和微观估值
- 第13章 行业分析
- 第14章 公司分析与股票估值
- 第15章 技术分析
- 第16章 股票组合管理策略

下册

第五部分 债券分析与管理

- 第17章 债券基础知识
- 第18章 债券分析与估值
- 第19章 债券组合管理策略

第六部分 衍生证券分析

- 第20章 衍生市场与衍生证券导论
- 第21章 远期和期货合约
- 第22章 期权合约
- 第23章 互换合约、可转换证券和其他嵌入式金融衍生工具

第七部分 资产管理规范与评估

- 第24章 专业资产管理
- 第25章 投资组合业绩评估

附录

全部参考文献列表

词汇表

索引

译后记

<<投资分析与组合管理>>

章节摘录

插图：但是究竟有哪些可供选择的投资工具呢？

到目前为止，我们在本书中关于金融市场投资机会的介绍并不多。

在本章，我们将解决这一问题，即全面考察金融市场上的各种投资工具。

这将为第2章讨论过的资产配置决策和后面章节中介绍的投资工具（例如，债券、普通股股票和其他证券）提供必要的背景基础。

同时，这对我们建立和评估投资组合也具有重要意义。

21世纪的投资者拥有几十年前没有的大量投资机会。

正如米勒（Miller，1991）所介绍的，金融市场的动态发展、技术进步以及最新的监管要求导致新的投资工具层出不穷，并且提供了更多的交易机会。

另外，通信技术的发展和国际管制的放松使得投资者能够在国内外金融市场上同时进行交易。

远距离通信网络使得美国经纪人不仅可以在纽约、芝加哥和其他美国城市的交易所进行交易，也可以在伦敦、东京以及其他欧洲和亚洲的交易所进行交易。

经纪行业的竞争和银行业的管制放松导致更多的金融机构展开客户竞争，以争取获得更多的资金。

这促使具有各种投资期限、风险与收益特征和现金流模式的投资工具不断涌现。

本章就将介绍其中的一些投资工具。

投资者在构建符合投资目标并且合理分散化的投资组合时，需要清楚了解投资工具之间的区别。

这就是说，投资者需要选择一组在投资期限内具有不同收益模式的投资工具来构建投资组合（portfolio）。

如果谨慎选择，该投资组合可以在给定收益率水平的前提下实现风险最小化。

这是因为，在投资期限内，某些投资工具的低收益率或亏损，可以被另外一些投资工具的高收益率所弥补。

投资的最终目标就是建立一个总收益率相对稳定的平衡的投资组合。

本章的一个主要目的就是帮助投资者认识和评估投资组合的风险与收益特征。

而进行分析的第一步就是对各种可供选择的证券类型进行评估。

<<投资分析与组合管理>>

编辑推荐

《投资分析与组合管理(第8版)(套装共2册)》为金融学译丛之一。

<<投资分析与组合管理>>

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>