

<<投资学>>

图书基本信息

书名：<<投资学>>

13位ISBN编号：9787309033359

10位ISBN编号：7309033353

出版时间：2002-9-1

出版时间：复旦大学出版社

作者：陈松男

页数：789

字数：656000

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>

## <<投资学>>

### 内容概要

本书系统地介绍了投资经济学的一般理论及其实务应用，其中包括众多现代投资学的理论，如资本资产评价理论、套利评价理论、选择权评价理论以及现代组合管理策略等，从而让读者对现代投资学有一个完整的认识。

本书内容适用于作为大学本科高年级与工商管理硕士（MBA）的投资学教材，也非常适合一般投资者对现代证券投资分析作通盘的了解。

## 书籍目录

第一章 证券市场功能与证券发行交易 一、简介 二、金融市场的重要功能 三、金融市场应具有的特征——有效率的市場 四、证券市场的类别 五、投资银行在新证券发行中所扮演的角色 六、投资银行所能提供的服务 七、股市对新证券上市的反应 八、结论 问答题 阅读资料第二章 投资报酬率与风险 一、简介 二、期望报酬率 三、单一期报酬率 四、复期报酬率 五、连续复利报酬率 六、股票报酬率的概率分配函数 七、投资风险的意义 八、投资风险的划分 九、结论 问答题 阅读资料第三章 经济分析与股票价格 一、简介 二、经济动态与股票市场的关系 三、经济分析 四、经济指标的使用与经济前景的预测 五、全球经济分析 六、整体股市价值的评估 七、总体经济变量与国际投资环境的辨认 八、经济分析实例 九、结论 问答题 阅读资料第四章 产业分析 一、简介 二、以商业循环分析产业前景 三、决定产业前景的因素 四、产业长短期前景分析的有关问题 五、产业生命周期与产业分析 六、国际产业前景分析简例 七、结论 问答题 阅读资料第五章 公司分析 一、成长股票的意义 二、公司前景的质量分析 三、以财务能力分析公司前景 四、公司前景的数量分析 五、决定本益比(市盈率)的因素 六、成长公司的股价分析 七、结论 问答题 阅读资料第六章 评估股票经济价值的基本原理 一、简介 二、会计对股票价值的评估方法 三、市场价值与经济价值 四、股利折现模型 五、勾顿模型 六、股利成长率与资本成本的估计 七、盈余保留率与股东报酬率对股票价格的影响 八、对多阶段成长公司价值的评估 九、自由资金折现模型 十、通货膨胀与股价的评价 十一、股利及盈余公布对股价的影响 十、结论 问答题 阅读资料第七章 技术分析 一、简介 二、整体股市价格走势的分析方法 三、个别股价技术分析 四、技术分析的学术实证 五、结论 问答题 阅读资料第八章 利率期间结构 一、简介 二、建立利率(期间)结构的重要性 三、零息债券利率结构的建立 四、付息债券利率结构的建立 五、利率期间结构理论 六、利率结构与经济循环及未来通货膨胀的关系 七、利率期间结构的补充要点 八、结论 问答题 阅读资料第九章 债券价格评估与品质鉴定 一、简介 二、债券的种类及其特征 三、债券投资的风险 四、债券价格的评估 五、债券价格与债券利率、报酬率及到期日的关系 六、不同债券报酬率的评估 七、税后债券到期报酬率的计算 八、债券总报酬率与其组成成分 九、债券应得报酬率的意义 十、债券品质等级的评鉴 十一、债券品质等级的评鉴方法 十二、债券价格与B的关系 十三、结论 问答题 阅读资料第十章 债券投资组合管理策略 一、简介 二、债券价格变动敏感度的衡量 三、敏感度的有关性质 四、利率风险免疫策略 五、积极性的债券投资管理策略 八、结论 问答题 阅读资料第十一章 股票选择权与其套利限制性质 一、简介 二、股票选择权的定义 三、买权及卖权契约的一些特征 四、选择权的损益结构 五、影响选择权价格的因素 六、套利限制性质 七、买卖权平价的意义及其应用 八、结论 问答题 阅读资料第十二章 股票选择权评价模型 一、简介 二、二项式评价模型 三、Black - Scholes评价模型 四、Black - Scholes模型的基本特征 五、股利分发与Blackscholes模型的调整 八、结论 问答题 阅读资料第十三章 选择权投资策略及组合管理上的应用 一、简介 二、利用买卖权价格失衡进行套利 三、买卖权与组合管理 四、买卖权投资策略 五、结论 问答题 阅读资料第十四章 投资风险分散与最佳投资组合：资本市场理论与应用 一、简介 二、分散投资风险的基本概念 三、投资组合的期望报酬率及风险的决定公式 四、投资组合分散风险的效力 五、效率投资组合的建立 六、效率投资组合的定义及其性质 七、投资者选认组合行为 八、直线效率边缘及资本市场理论 九、资本市场理论的延伸 十、结论 附录 问答题 阅读资料第十五章 国际证券投资与风险分散 一、简介 二、国际证券投资分析 三、国际股票投资的比较 四、国际股票投资的效益 五、汇率风险与国外股票投资 六、国际债券投资的优劣分析 七、国际债券投资的比较 八、国际债券投资的效益与汇率风险 九、国际投资组合的汇率风险规避策略 十、国际资本市场的分隔或整合 十一、国际股票市场与企业的相关 十二、跨国公司是否是良好的国际风险分散工具 十三、结论 问答题 阅读资料第十六章 资本资产评价模型 一、简介 二、资本资产评价模型 三、资本资产评价模型的经济意义 四、资本资产评价模型的实务应用 五、资本资产评价模型的延伸 六、资本资产评价模型与利率变动 七、规避利率风险组合的选择 八、规避其他风险的组合选择 九、多种风险因素资产评价模型 十、结论 问答题 附录 阅读资料第十七章 套利评价理论 一、简介 二、套利评价理论的推演 三、套利评价模型与资本资产评价模型比较 四、实证研究与经济意义 五、在股票投资方面的应用 六、国

际套利评价理论 七、决定国际股价的重要因素 八、结论 问答题 阅读资料第十八章 现代最佳组合选择与通货膨胀的考虑 一、简介 二、通货膨胀与两因素报酬率诞生模型 三、通货膨胀环境下的最佳组合 四、实例与经济涵义 五、不可卖空股票限制下最佳组合的建立 六、EGP最佳组合的建立方法 七、结论 问答题 阅读资料第十九章 组合管理的基本理论 一、简介 二、发掘优异与拙劣股票的方法 三、Treydor - Black模型——建立积极组合 四、选时能力 五、选时能力的实证 六、利用因素模型发掘优良或拙劣股票 七、结论 问答题 阅读资料第二十章 共同基金与绩效的评鉴方法 一、简介 二、投资公司—共同基金 三、投资共同基金的优点 四、共同基金的种类 五、传统绩效评鉴方法 六、有关评鉴法的问题与缺点 七、对选股及选时能力的评鉴 八、国际共同基金绩效评鉴的实证 九、结论 问答题 阅读资料第二十一章 投资组合策略的实务应用与管理 一、投资目标 二、投资限制条件 三、投资策略 四、规避通货膨胀风险策略 五、税率与资产配置 六、结论 问答题 阅读资料

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>