第一图书网, tushu007.com

<<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：9787309041767

10位ISBN编号：7309041763

出版时间：2004-10

出版时间：复旦大学出版社

作者：徐华青，肖武侠，卢晓生

页数：325

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

第一图书网, tushu007.com

前言

21世纪世界经济的发展特征是全球化、数字信息化和金融化。
世界金融市场的蓬勃发展产生了对合格金融专业人员的大量需求、对世界金融通行语言和通行标准的需求。
投资人、企业和金融管理层都需要一个统一的、规范的标准来衡量金融分析人员的知识水平、道德规范和专业化程度，从而建立起对他们所提供的金融服务和管理金融资产能力的信赖。

伴随着中国加入wTO，我国金融市场国际化的步伐必将进一步加快，因此我们必须按照国际标准来参与竞争，了解、熟悉国际标准，参与制定国际标准，才能在国际市场竞争的过程中处于主动的、有利的地位。
金融从业人员，包括基金经理、证券分析师、财务总监、投资顾问、投资银行家、交易员等等，不仅要掌握严格而全面的系统的金融知识体系，掌握金融投资行业各个核心领域的理论与实践知识，包括从投资组合管理到金融资产估价，从衍生证券到固定收益证券以及定量分析等，而且要积极了解、熟悉国际标准，参加国际金融交流活动，研讨世界金融市场发展的动向，借鉴国外通行的行业标准来规范中国金融市场的发展，这是对中国的金融市场有长远意义的一件大事。

CFA(2hartered Financial Analyst，注册金融分析师)是通行于世界的金融分析资格证书，要获取证书不仅要通过严格的三级考试，而且要求持证人遵守必需的职业伦理规范。
由于认证机构注册金融分析师学会(CFA Institute)严格地遵从这一准则，所以，CFA证书在全球投资分析和投资管理界享有较高的声誉，从某种程度上来说，CFA代表着在国际投资界和投资管理界的一种通行的高标准。
越来越多的中国金融从业人员关注和学习CFA的知识体系，近两年来中国地区参加考试人数呈骤增趋势。

第一图书网, tushu007.com

<<投资组合管理>>

内容概要

《投资组合管理》由浅入深地讲解了一些经典模型，如有效市场理论、马柯维茨组合投资理论、CAPM等等，并且也简略地讨论了最近一些金融学前沿。
《投资组合管理》对西方投资理论的介绍是比较完整的，对投资理论在组合管理中的应用也分析得很全面，还颇具匠心地从两个新的视角来介绍国际上投资组合理论和实践的进展。
因此《投资组合管理》不仅可以作为各级注册金融分析师考试的参考书，而且可以作为金融从业人员及金融专业学生的教材。

第一图书网, tushu007.com

<<投资组合管理>>

书籍目录

前言基 础 篇1 投资的背景知识1.1 投资的概念1.2 金融资产与金融市场1.3 衍生金融工具简介2 资产配置2.1 个人投资生命周期2.2 投资计划的作用2.3 投资计划的构成3 投资收益与风险3.1 投资收益率3.2 投资风险理 论 篇4 有效市场理论4.1 有效市场假设4.2 有效市场假设检验4.3 有效市场运用5 马柯维茨组合理论5.1 财富效用函数与无差异曲线5.2 有效市场边界6 资本资产定价模型6.1 模型的前提假设6.2 资本市场理论6.3 证券市场线6.4 定价公式6.5 模型扩展和检验7 套利定价理论7.1 套利的含义7.2 套利定价理论的假设7.3 套利组合条件分析7.4 套利定价理论7.5 APT与CAPM的区别和联系7.6 套利定价模型检验分 析篇8 财务报表分析8.1 财务报表简介8.2 财务比率计算8.3 财务比率应用9 债券分析9.1 债券基础知识9.2 债券定价基础9.3 利率期限结构9.4 债券久期与凸度10 股票定价与组合管理10.1 股票定价分析基础10.2 股票定价模型10.3 股票组合管理11 期权定价与组合管理11.1 期权定价分析基础11.2 期权定价理论11.3 期权的应用专 题 篇12 投资的国际视角12.1 外汇交易12.2 汇率平价理论12.3 货币风险管理12.4 国际资产定价13 行为金融理论13.1 行为金融研究主题13.2 行为金融理论13.3 行为金融学的应用和展望附 录附录1 数学附录附录2 金融与投资网站资源附录3 股票指数参考文献

第一图书网, tushu007.com

<<投资组合管理>>

编辑推荐

注册金融分析师(CFA)资格考试被称作“全球金融第一考”，CFA是当今世界证券投资与管理界普遍认可的一种职业称号。
目前，中国高级金融人才奇缺，金融分析师更是存在着巨大的供需缺口，越来越多的中国金融从业人员关注和学习CFA的知识体系，每年报考CFA的人数呈递增趋势。

本系列丛书的出版将促进最新金融理论和方法的传播，具有实用性、通俗性、创新性特点。
不仅仅是中国参加CFA⑩应试的各级考生辅导丛书，而且对于金融分析人员、投资组合管理人员及有志于在金融领域有所发展的金融爱好者来说，本丛书有助于他们掌握CFA的知识体系和伦理规范、现代组合管理和投资分析的规范与理念，是了解国际通行做法的一个窗口。

——国务院发展研究中心名誉主任，综合开发研究院(中国·深圳)理事长马洪

第一图书网, tushu007.com

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