第一图书网, tushu007.com

<<投资组合管理通解>>

图书基本信息

书名：<<投资组合管理通解>>

13位ISBN编号：9787309049718

10位ISBN编号：7309049713

出版时间：2006-4

出版时间：复旦大学出版社

作者：陈昊

页数：370

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

前言

陈昊先生要我为本书写序，使我不得不将这本书稿认真阅读了一遍。
我发现，这类题材在国内是不多见的。
在阅读过程中，我感到似乎有一股巨大的力量将我推到一个波澜壮阔的金融投资海洋之中，我不得不为作者丰富的知识所折服，更为作者所列举的一些针对实践的精要分析而喝彩。
人类经济的发展来源于理论知识向商业化社会大生产的转化，而金融投资则是这个大生产转化的催化剂。
中国的经济近年来的突飞猛进令世人瞩目，过去那种低效率、低附加值的产出正在被高科技、高效能的产出所取代，金融投资在整个经济链中的作用绝对不容忽视。
要对金融投资、投资组合管理进行科学的运作，并收到良好的效果，显然并不是一件简单的事情。
本书则对金融投资和组合管理进行了全面新颖的诠释。
在我阅读过的文章中，这种全方位的介绍似乎并不多见。
就拿特许金融分析师（CFA）考试来说，十年前，在中国内地通过考试并获此证书的人士寥若晨星。
如今，参加特许金融分析师资格考试的人群正日趋壮大，每年通过此项考试的人也在逐渐增多，金融投资已经得到越来越多成功人士的关注。
陈昊先生在本书中，娴熟地对特许金融分析师资格三级考试的要点作了巧妙的论述，相信关注特许金融分析师考试的专业人士必然会从中得到裨益。
如果将经济体系比喻成一座灯塔，也许金融就是灯塔上端的数盏明灯，它昭示的是当代经济发展的亮度。
西方有一句谚语:幸运女神只青睐那些对机会有准备的人。
我相信，本书的问世，一定会对金融行业高端人群带来帮助，也将会为你的腾飞添上强劲而柔软的羽翼。

<<投资组合管理通解>>

内容概要

金融投资、组合和管理，是现代经济学中重要的新兴学科，对整个国民经济、甚至全球经济体系良性有序地发展起着举足轻重的作用。

《投资组合管理通解》就是从这一基点出发，从理论到实践作了全面的阐述。

全书以特许金融分析师资格考试的知识体系为蓝本，对投资者的投资目的和投资限制进行深入的分析，对资本市场的趋势及走向分析方法进行阐述，对资产配置策略进行描述，对组合风险敞口的管理进行详解，并剖析组合投资表现评估技巧，对整个投资组合动态的管理流程作出了全面解析。

《投资组合管理通解》针对特许金融分析师资格三级考试的特点，对各个知识要点作了全新的诠释，对特许金融分析师考试的要点和技巧，也作了周详的解析。

此外，《投资组合管理通解》还结合金融投资领域的运用实例，从操作的角度，进行了全景式描述。

《投资组合管理通解》适合特许金融分析师资格三级考试的考生阅读。

对从事金融投资管理的高端从业人员来说，也是一本有价值的读物。

《投资组合管理通解》中的理论和实践，更为欲领略金融投资独特魅力的读者，展现了一幅绚烂的图景。

作者简介

陈昊，荷兰伊莱斯姆斯大学鹿特丹商学院金融投资管理硕士(RSM，Erasmus University)，特许金融分析师持证人(CFA Charter Holder)和美国金融风险管理师持证人(FRM Charter Holder)，在企业上市、并购重组、金融风险管理和企业风险管理、企业融资和财务咨询等专业领域拥有约10年国内外实务操作经验。
此外，还为国内多家金融机构提供包括风险管理、流程重组、量化建模、理财规划等多方面的内部培训服务，亦和国内的专业培训机构金程教育合作，推广企业全面风险管理和职业道德规范的理念与实践。
曾经先后参与编著出版了《企业内部控制和风险管理——萨班斯奥克斯利法案释义》一书以及《风险管理——原理与方法》一书，并通过国内外多家专业媒体发表关于国内金融体制改革和实践的观点。

<<投资组合管理通解>>

书籍目录

关于特许金融分析师协会特许金融分析师协会的历史特许金融分析师资格致特许金融分析师资格三级考试考生关于本书的结构第一讲 权衡的艺术--从投资场景分析到资产组合的建立概述篇--投资组合管理的理念持续的投资组合管理考试内容综述专题篇第一章 个人投资者场景分析第一节 投资政策声明的要件第二节 投资政策声明中平衡的艺术第二章 机构投资者的场景分析第一节 固定收益养老金计划的投资政策声明第二节 基金会的投资政策声明第三节 捐赠基金的投资政策声明第四节 寿险公司的投资政策声明第五节 财险公司的投资政策声明第六节 商业银行的投资政策声明第三章 资产组合的建立第一节 资产组合分配理论第二节 资产分配策略第三节 资产组合建立试笔篇个人投资者场景分析机构投资者场景分析提要篇知识要点回顾个人投资者场景知识要点回顾机构投资者场景的知识要点回顾关于投资者承担风险的能力资产组合建立知识要点回顾第二讲 行为的逻辑--从宏观到微观的经济行为概述篇--知识体系从点到面的融会贯通货币金融在资本市场的演绎行为金融在投资决策中的表现专题篇第一章 股票市场投资和投资回报第一节 股票风险溢价第二节 股票市场评估模型第三节 美国股票市场1990年代回顾第四节 汇率市场预测模型第二章 投资者的行为金融学第一节 投资行为心理第二节 投资者行为模拟习题第三章 其他可供选择的投资方式第一节 房产物业投资和投资估值第二节 私募资本第三节 对冲基金第四节 困厄债务投资第五节 商品期货投资试笔篇提要篇第三讲 度量的学问--从投资估值、业绩评价到国际投资业绩标准概述篇--资本市场指数产品在业绩评估中的标杆作用专题篇第一章 投资估值的基本原理第二章 全球化投资对组合的影响第三章 基金和投资账户收益回报的量化第四章 投资业绩评估第一节 直接比较法第二节 投资业绩归因评估法第三节 风险调整业绩评估法第五章 投资业绩评估基准的设定第一节 狭义风格/规模基准和广义基准评估第二节 权益投资风格在投资和业绩评估中的使用第三节 市场投资风格指数的介绍第四节 组合风格分析法和回报风格分析法第五节 固定收益证券基准第六节 私募基金基准第六章 全球投资业绩评估第一节 全球业绩评估第二节 全球投资业绩标准试笔篇提要篇附录:全球投资业绩评价标准第四讲 创新的动力--从债券组合到投资组合衍生品的运用概述篇--从资产负债管理到衍生产品组合管理的演绎金融投资中的资产负债管理固定收益证券的特性专题篇--固定收益证券投资和衍生产品在组合中的运用第一章 固定收益证券基础知识讲解第一节 货币的时间价值和利率的形成第二节 利率市场中的期限结构、即期利率和远期利率第三节 利率风险和再投资风险、久期和凸度第四节 固定收益债券产品介绍第五节 久期和凸度的运用第二章 固定收益债券的组合管理第一节 固定收益债券组合管理概览第二节 衡量债券组合的风险第三节 债券市场指数第四节 债券组合的杠杆应用第五节 免疫债券组合和现金流配比第三章 固定收益债券组合的全球化管理第一节 国际固定收益债券组合的相对价值法第二节 国际债券组合管理的实践第四章 衍生产品在投资组合中的运用第一节 利率风险管理中的衍生产品使用第二节 抵押债券的使用第五章 衍生产品全方位的诠释第一节 图形分析法在期权组合中的运用第二节 期权分析中的希腊字母指标第六章 互换和信用衍生金融产品的运用第一节 互换产品的运用第二节 信用衍生产品的运用试笔篇提要篇第五讲 数字的诠释--从投资组合量化的技巧到对风险的考量概述篇--量变和风险投资组合量化技巧概览风险管理概览专题篇--风险的量化和管理第一章 数字的跳跃第一节 统计学和计量经济学知识的回顾第二节 多元线性回归建模中存在的问题第三节 时间序列模型分析第二章 投资组合风险的考量第一节 企业全面风险管理构架第二节 风险中价值的运用第三节 压力测试第四节 市场风险、信用风险和非金融风险的衡量和管理第五节 风险预算和资本分配试笔篇提要篇附录一 Students T-Distribution附录二 F-Table at 5 Percent附录三 Chi-Squared Table第六讲 职业的理念--从职业道德标准到实践中的规范概述篇--职业的理念专题篇--职业道德标准和实践规范第一章 道德规范第二章 职业行为标准第一节 职业操守第二节 资本市场信誉第三节 对客户的责任第四节 对雇主的责任第五节 投资分析、建议和行动第六节 利益冲突第七节 CFA会员或CFA考生的责任试笔篇提要篇

编辑推荐

本书以特许金融分析师资格考试的知识体系为蓝本，对投资者的投资目的和投资限制进行深入的分析，对资本市场的趋势及走向分析方法进行阐述，对资产配置策略进行描述，对组合风险敞口的管理进行详解，并剖析组合投资表现评估技巧，对整个投资组合动态的管理流程作出了全面解析。

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