

<<投资学>>

图书基本信息

书名：<<投资学>>

13位ISBN编号：9787309091588

10位ISBN编号：7309091582

出版时间：2012-9

出版时间：复旦大学出版社

作者：张宗新

页数：348

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>

## 内容概要

《金融专业硕士核心课程系列教材·投资学：证券分析与投资管理》的设计理念，就是力图通过证券投资理论分析与应用，培养科学的投资理念和不断提升证券分析能力，力图使读者能够达到投资大师本杰明。

格雷厄姆（ Benjamin Graham ）所谓的投资境界——“ 聪明的投资者 ”。

《金融专业硕士核心课程系列教材·投资学：证券分析与投资管理》的主要内容包括：证券投资的专业化基础，资产组合理论及应用，证券资产定价理论及应用，EMH、随机漫步及投资应用，宏观经济和行业分析，基于价值评估的上市公司财务报表分析，股票估值模型及应用，利率期限结构：理论与应用，期货与期权：定价及应用，基金投资风格与绩效评价，资产配置与投资策略，金融工程与投资风险管理。

《金融专业硕士核心课程系列教材·投资学：证券分析与投资管理》适合金融专业硕士及相关经济、金融专业师生选作教材使用，也可作为金融领域的实践工作者的参考材料。

## 作者简介

张宗新，复旦大学金融研究院金融学教授，主要从事证券市场研究。1998年、2002年分别获得吉林大学经济学硕士、博士学位，2002-2004年在复旦大学从事博士后研究工作，并获得复旦大学优秀博士后称号。在《经济研究》、《金融研究》、《管理世界》等核心刊物发表论文60余篇。

## 书籍目录

前言第一章 证券投资的专业化基础第一节 投资专业化和机构投资者的兴起一、证券市场快速发展是专业化投资分析的基本前提二、机构投资者的兴起是专业化投资分析的市场需求第二节 证券投资与投资分析一、投资行为的内涵解析：基于证券分析的视角二、证券投资分析的三大功能三、内在价值和市场价格四、证券分析师第三节 专业化证券投资管理方式一、自上而下和自下而上二、积极投资和消极投资三、定性分析和定量分析第四节 证券投资分析与管理：风险视角一、首先应该“彻底的分析”二、投资的第二要素是应“避免损失”三、投资的第三要素是关注“适当期望”本章小结本章思考题第二章 资产组合理论及应用第一节 资产收益与风险一、收益率的度量二、风险的度量三、资产组合的收益率与方差四、投资者风险偏好及其效用函数五、风险溢价与超额收益第二节 资产组合分散化一、分散化理论二、组合分散化的效果四、均值一方差准则（MVC）第三节 资产组合的最优化一、投资组合的风险机会集（risky opportunity set）二、不允许无风险借贷时的资产组合最优化三、允许无风险借贷时的资产组合最优化第四节 资产组合边界和有效前沿一、资产组合边界的确定二、均值一方差有效前沿的形成三、均值一方差有效前沿的表达及其求解四、有效组合边界在投资管理中的应用本章小结本章思考题第三章 证券资产定价理论及应用第四章 EMH、随机漫步及投资应用第五章 宏观经济和行业分析第六章 基于价值评估的上市公司财务报表分析第七章 股票估值模型及应用第八章 利率期限结构：理论与应用第九章 期货与期权：定价与应用参考文献

<<投资学>>

编辑推荐

《金融专业硕士核心课程系列教材·投资学：证券分析与投资管理》的目的是培养科学的投资理念和不断提升证券分析能力。

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>