

<<现代金融投资统计分析>>

图书基本信息

书名：<<现代金融投资统计分析>>

13位ISBN编号：9787503756344

10位ISBN编号：7503756349

出版时间：2009-4

出版时间：中国统计出版社

作者：李腊生，翟淑萍 著

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>

## <<现代金融投资统计分析>>

### 内容概要

《现代金融投资统计分析》从统计分析视角给出主要金融变量的度量、金融变量之间的统计关系、金融市场价格决定的统计特征及基本原理，较为全面和系统地介绍了经典投资学理论，尤其是介绍了20世纪90年代以来投资学领域重要的和最新的发展。

全书在对投资学理论进行阐述的同时，对有代表性的现代金融投资模型及相关定理进行了系统的梳理，并给出了较为详尽的数学推导与证明。

另外，《现代金融投资统计分析》除了配有大量案例以增强实用性和可操作性外，还包含了作者对金融投资问题的一些个人理解。

## &lt;&lt;现代金融投资统计分析&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 基本理论第一章 金融、不确定性与统计分析第一节 金融的内在不确定性与统计分析第二节 金融市场价格变动的随机性与统计分析第三节 金融风险管理中的统计方法第四节 金融投资与预期第二章 风险偏好及选择第一节 效用函数第二节 风险的度量第三节 风险承受能力及其偏好第四节 无差异曲线第五节 风险与收益的权衡及其选择第三章 无套利与有效市场假说(EMH)第一节 无套利分析第二节 有效市场假说(EMH)第三节 EMH的经验分析第四节 分形简介第五节 分形统计学简述第六节 分形在金融投资中的应用第二篇 基本模型第四章 证券投资组合模型第一节 风险分散与相关分析第二节 证券投资组合模型第三节 投资组合模型的解与两基金分离定理第四节 证券投资组合的选择第五节 算例第五章 资本资产定价模型(CAPM)与因素模型第一节 资本市场线第二节 资本资产定价模型(CAPM)第三节 因素模型第四节 总风险的分解第五节 单因素的套利定价模型(APT)第六节 多因素的套利定价模型(APT)第七节 APT与CAPM的比较第六章 VaR与风险管理第一节 置信水平与统计预测第二节 VaR简介第三节 VaR的计算第四节 随机过程与VaR第五节 预测方差—协方差矩阵计算VaR\*第三篇 工具与市场统计分析第七章 债券投资与利率风险第一节 债券投资的收益率度量第二节 利率第三节 利率期限结构与收益率曲线第四节 债券投资的风险第五节 负债工具投资选择第六节 我国上市公司财务危机的判断与预警—基于因子分析Logit模型的经验证据第八章 股票市场投资分析第一节 股票及股票市场第二节 普通股定价模型第三节 普通股投资分析第四节 对股票投资价值的重新思考第九章 外汇市场与汇率风险第一节 外汇市场与汇率第二节 汇率决定与指数第三节 购买力平价理论的指数描述第四节 利率平价理论的指数描述第五节 费雪方程及汇率决定理论第六节 外汇市场投资策略分析第十章 期货市场及杠杆投资第一节 期货市场交易特征及规则第二节 期货产品定价第三节 期货交易中的套期保值第四节 风险偏好与杠杆投资决策第五节 远期协议交易与期货交易的比较第六节 算例第十一章 期权市场及期权定价模型第一节 期权简介第二节 期权中的风险锁定第三节 期权定价)——二叉树方法第四节 风险中性下的二叉树定价第五节 随机游走模型及布朗运动第六节 布莱克—斯科尔斯(Black-Scholes)模型\*第七节 风险中性的期权定价公式第八节 相关变量对期权价值的影响附录：部分参考与练习题答案主要参考文献

<<现代金融投资统计分析>>

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>