第一图书网, tushu007.com

<<积极型投资管理的博弈与探索>>

图书基本信息

书名：<<积极型投资管理的博弈与探索>>

13位ISBN编号：9787505874909

10位ISBN编号：750587490X

出版时间：2008-8

出版时间：经济科学出版社

作者：张蜀林,周莉

页数：184

字数：160000

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

全书共八章，绪论是研究的前期准备和相关文献的简要回顾，包括组合投资、不确定决策、风险度量的若干发展与思考。

从投资管理的博弈本质出发，本书深入研究了不对称信息、不确定条件下积极型投资管理的理论基础、风险识别、策略设计、业绩评价与实证分析，为不对称信息、不确定条件下积极型投资管理的理论建立提供了一个基本框架。

本书的一个重要贡献，是从资本市场的博弈本质出发，将投资管理的理论纷争归结为基于不确定性的单人决策和基于不对称信息的群体博弈两大体系，从本质上把握了单人决策观(第一章)、不对称信息观(第二章)、群体博弈观(第三章、第六章、第七章)下不同投资管理理论体系的核心区别与内在联系。

书籍目录

绪论 1.研究的背景与动机 2.研究的基本思路 3.组合投资的理论构架、代表性方法及其进展 4.不确定条件下的投资决策理论一一非期望效用准则 5.风险度量、风险测度相关研究概述 6.积极的投资管理：从理论模型到实践应用的跨越第一章 单人决策观下的投资管理 1.1 市场价格的随机游走 1.2 有效市场假说 1.3 随机游走理论与有效市场的关系 1.4 随机游走理论与有效市场假说对投资管理的重要意义 1.5 被动投资经典理论的主要缺陷 1.6 资本市场信息传递的有效性与投资者信念的对立 附录第二章 信息观下的投资管理 2.1 信息成本与价格形成 2.2 不对称信息与交易策略 2.3 从瓦尔拉斯均衡到理性预期均衡 2.4 价格形成与交易策略研究的重要意义第三章 积极型投资管理的理论基础：静态博弈 3.1 投资管理的博弈思想及其发展脉络 3.2 博弈观下的投资管理：被动投资理论的重大发展 3.3 投资管理、投资策略分析的基本框架 3.4 零和博弈规律对投资策略设计的含义 3.5 积极型投资管理的理论基础 3.6 价值型积极管理的理论基础第四章 积极型投资管理：业绩度量、策略设计与评价 4.1 业绩评价的基本方法 4.2 积极型投资管理的狭义与广义内涵 4.3 积极型投资管理与被动投资的比较 4.4 业绩度量指标及其风险识别 4.5 业绩度量：风险偏好函数或评价函数的简要回顾 4.6 积极型投资管理的策略设计与评价第五章 积极型组合管理：实证分析 5.1 研究背景与动机 5.2 国外证券市场的可预测性文献的简要回顾 5.3 研究方法 5.4 实证分析主要结果第六章 积极型投资管理中的动态博弈：少数博弈借鉴 6.1 阿瑟(Arthur)(1994)的埃尔·法罗尔(El Farol)酒吧难题 6.2 少数博弈的经典模型 6.3 少数博弈模型的基本特征 6.4 标准少数博弈模型的主要缺陷 6.5 少数博弈模型的主要意义第七章 积极型投资管理中的动态博弈：短期投资的群体博弈 7.1 博弈的信息结构与交易策略的构造 7.2 短期交易策略的预期支付的测算 7.3 短期投资的均衡及其稳定性分析 7.4 从个体博弈到群体博弈，群体之间的对抗与群体内部的竞争第八章 中国上市公司的经济绩效考核与业绩风险防范 8.1 国内上市公司业绩评价与财务风险防范的简要回顾 8.2 基于经济利润的业绩考核：理论探索 8.3 基于经济利润的业绩分析与绩效考核 8.4 经济业绩评价与业绩风险防范：实证分析致谢

章节摘录

第一章　单人决策观下的投资管理　　对资本市场信息有效性的关注，起源于人们对证券的价格看似杂无章的变化给以经常的解释。
例如，市场价格的变动是否遵循某种潜在的规律，能否预测？
如果市场价格的变动能够预测，需要依据何种信息？
……

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