

<<破解CFA组合管理和职业伦理>>

图书基本信息

书名：<<破解CFA组合管理和职业伦理>>

13位ISBN编号：9787509530863

10位ISBN编号：7509530865

出版时间：2012-1

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：林晨雷

页数：112

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>

## <<破解CFA组合管理和职业伦理>>

### 内容概要

破解CFA组合管理和职业伦理（1级和2级考试适用）》用最简单有效的逻辑把CFA考点串起来，帮助考生梳理CFA知识架构，便于考生记忆。  
使用《注金融分析师（CFA）考试指导书之2：破解CFA组合管理和职业伦理（1级和2级考试适用）》学习时应特别注重掌握各考点之间的内在逻辑，而不要把各个考点割裂开来单独理解。

## <<破解CFA组合管理和职业伦理>>

### 作者简介

林晨雷，CFA持证人，香港财经分析师学会会员，欧盟中国经理人协会（EUCMA）会员。自2004年开始即主讲CFA、FRM及CFP课程，在金融数量分析、投资组合管理、金融衍生产品、固定收益证券、另类投资等方面拥有多年培训实战经验。曾为1：商银行总行、中国银行总行、交通银行总行、中国邮政集团、中投证券、大都会人寿等诸多机构提供内部培训。曾编著多本CFA教材，也是CFA试题研究专家，三级考试均一次通过，对出题思路 and 方向有独到把握。

## <<破解CFA组合管理和职业伦理>>

### 书籍目录

#### 第一部分 CFA一级组台管理

##### 第一章 组合管理概述

投资组合的视角

投资客户概述

组合管理的步骤

集合投资工具概述

##### 第二章 投资组合管理理论

收益率和风险

现代投资组合理论

资本市场理论

资本资产定价模型

资本资产定价模型的应用

##### 第三章 投资组合的计划步骤

投资政策陈述概述

投资政策陈述的主要内容

战略资产配置

#### 第二部分 CFA二级组合管理

##### 第四章 组合管理理论的实践应用

输入参数

市场模型

调整贝塔系数

资本资产定价模型的有效性

##### 第五章 多因子模型和套利定价理论

多因子模型

套利定价理论

纯因子组合与循迹组合

##### 第六章 国际资产定价

国际资本市场的整合与分割

推广的CAPM

国际CAPM

汇率风险敞口

##### 第七章 主动投资组合管理理论

主动投资的收益和风险

主动投资组合管理的必要性

Treynor - Black模型

预测精确性及对输入参数的调整

##### 第八章 组合管理步骤和投资政策陈述

组合管理的步骤

投资政策陈述概述

<<破解CFA组合管理和职业伦理>>

投资政策陈述的主要内容

.....

第三部分 CFA职业伦理

<<破解CFA组合管理和职业伦理>>

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>