第一图书网, tushu007.com

<<金融衍生工具与投资管理计量模型>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生工具与投资管理计量模型>>

13位ISBN编号：9787801628169

10位ISBN编号：7801628160

出版时间：2004-4

出版时间：经济管理出版社

作者：弗朗西丝·考埃尔

页数：406

译者：赵志义

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

本书的目的并非向读者提供有关投资、产品甚至投资策略方面的建议，而是使读者对上述方面具有足够的了解。
为此，本书开篇从基金结构、投资策略定义到投资管理人的投资选择以及对投资效果的评估方面探讨了投资管理过程。
接下来探讨了传统的投资方法以及计量投资方法的基本原理。
第二章逐一地解说投资过程的具体步骤：首先是资产配置，继之以每一资产的投资建构。
在每一步骤中，把基础理论和操作过程放在情境当中进行解说。
然后，探讨一些个别的问题，包括每一种方法的优缺点及其应用。
最后，说明投资的实施过程、经营、估价、收益率评估以及投资管理过程中一些常见的问题以及那些与企业总体有关的问题。
最后，探讨传统方法和投资管理计量方法如何能够相互适应的途径。

作者简介

弗朗西丝·考埃尔多年来一直关注计量技术在投资组合管理中的应用。
目前她在伦敦为Vestek-Quantec工作，这是Thomson Financial的一家分支机构。
在于1998年加入Quantec之前，考埃尔是悉尼Natwest Investment Management旗下计量投资团队中的一员，在那里，她负责国内与国际指数证券投资组合与指数化平衡投资组合的工作。

书籍目录

第一部分 引 言第一章 引言 投资管理的演进 投资基金的结构界定 投资顾问的作用 投资策略 投资管理委托书 管理人的选择 投资组合评估 托管机构的作用第二章 传统的投资方法 资产种类配置 资产种类内的证券选择 传统方法的局限性 传统投资管理的趋势第三章 投资管理理论 效畜市场假说（EMH） 资本资产定价模型（CAPM） 优化投资组合及投资组合的优化 预期的以及测定的收益率与风险 风险值（VAR） 风险预算 逆向优化 利率 第二部分 投资组合的创建第四章 资产配置计量模型 应用 理论 长期资产配置 短期资产配置 风险管理 短期资产配置的实施 衍生工具的使用 即时控制 业务管理 评估 业绩测量与定性分析 隐患 案例研究第五章 投资组合保护 应用 理论 期权定价 布莱克—斯科尔斯与CPPI的对比 实施 即时控制 货币管理 业务管理 评估 业绩测量与定性分析 隐患 ……第六章 资本担保投资组合第七章 消极资产配置第八章 国内股票投资组合计量模型第九章 国际股票投资组合计量模型第十章 优化股票选择模型第十一章 指数化第十二章 定息投资组合第十三章 不动产投资组合第十四章 市场中立（对冲）投资组合与其他另类投资种类第十五章 投资组合的移交与移交型投资组合第十六章 货币管理第十七章 股票投资组合的实施第十八章 业绩测量与定性分析第十九章 软件在投资管理中的应用第二十章 投资管理的趋向第二十一章 结论：传统与计量的对比 第四部分 附 录附录1 利率证券的定价附录2 远期交易合约附录3 期货合约附录4 掉期附录5 期权附录6 可兑换票据和可转换债券术语词汇表参考书目

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