

<<投资管理>>

图书基本信息

书名：<<投资管理>>

13位ISBN编号：9787111299776

10位ISBN编号：7111299779

出版时间：2010-3

出版时间：机械工业出版社

作者：李学峰 编

页数：269

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>

## &lt;&lt;投资管理&gt;&gt;

## 前言

目前,在国际金融市场上,投资管理日益标准化,且其与最新的金融理论的研究进展结合得也日趋紧密。

随着我国金融市场,特别是资本市场的发展与开放,投资管理也逐渐摆脱了曾经盛行于市场的技术分析,开始走向科学化和程序化。

本教材即以投资学、金融市场学和行为金融学的经典理论及其最新进展为基础,对投资管理的理论、模型、内容、方法、程序及其评价等进行深入研究和探讨。

本书的内容结构安排如下: 第一篇解决机构投资管理中面临的两个重要的问题,一是对投资管理中投资组合构建和调整的合理性给出判断的原则和指标,二是对积极组合管理的能力给出衡量。本篇由3章内容构成,第1章回顾资产组合理论的核心内容及其应用,第2章对资本资产定价模型及其应用进行介绍,第3章对投资组合构建与调整的合理性,以及积极组合管理的内容及其能力的高低进行研究和评价,旨在帮助读者更为全面地观察和理解投资绩效问题,而且对解答如何提高投资组合构建和调整的科学性、改善投资组合管理能力和水平都将有所启示。

实际上,前3章也是读者理解和学习机构投资的重要理论基础。

第二篇关注的是机构投资者的组合管理,包括组合资产配置方式和组合投资风格的选择两大方面,以及这两大方面对机构投资绩效的影响。

具体而言,第4章将对投资管理过程中的又一核心环节—资产配置进行研究,旨在帮助读者学习资产配置的内涵、战术性资产配置的方法与内容,以及如何衡量和提高资产配置能力。

第5章将在学习资产配置管理的基础上探讨投资风格的问题,将帮助读者学习机构投资者投资风格的分类、投资风格的选择,以及投资风格如何衡量等问题。

第6章将解答投资组合的总体资产配置情况对投资收益的影响、资产配置的细分方式对收益的影响等一系列问题,这不仅可以在理论上深化对资产配置的理解,并且能为提高决策效率和管理水平提供参考;同时,也为读者科学地评价投资管理能力提供更为科学的依据。

第三篇由3章内容组成,第7章介绍投资风险与监控,其中特别研究了对机构投资者有重大影响的流动性风险和操作风险,第8章集中研究了投资绩效评价方法,第9章则对影响绩效的行为因素进行了分析。

需要强调的是第9章对行为金融理论的研究。

由于资产组合的构建与调整离不开投资者具体的投资行为,投资过程中产生的多数非系统性风险也是投资者行为的直接产物,同时投资绩效也是投资者行为选择导致的一个行为后果。

因此,虽然现代投资管理越来越规范化和标准化,但无时无刻不受投资者行为和心理状态的影响。

基于这种思考,本书将在第9章中以行为金融学(behavioral finance)为理论基础,在对投资者行为选择的内涵界定、模型表述、行为后果进行分析的基础上,揭示行为管理的重要性及其实施。

这也体现了本书的一大特色。

第四篇将对有可能影响未来投资管理机构发展趋势的产品管理—产品设计与营销,以及股权投资管理进行研究。

具体地,第10章将以证券投资基金为例,对基金产品设计和产品营销管理进行介绍和探讨,而第11章将就私募股权基金的基本概念、理论以及实际运作中的投资管理进行阐述。

## <<投资管理>>

### 内容概要

随着我国金融市场，特别是资本市场的发展与开放，投资管理也逐渐摆脱了曾经盛行于市场的技术分析，开始走向科学化和程序化。

本书以投资学、金融市场学和行为金融学的经典理论及其最新进展为基础，对投资管理的理论、模型、内容、方法、程序及其评价等进行了深入研究和探讨。

本书重点突出、体系完整、具有前瞻性；理论紧密联系实际，易于理解、便于教学、适用范围广泛。

本书可供高等院校经济学、金融学、投资学等相关专业本科生、研究生使用，也可供MBA学员使用，还可作为投资、金融行业专业人士的参考读物。

## &lt;&lt;投资管理&gt;&gt;

## 书籍目录

前言	教学建议	第一篇 投资组合理论与组合管理	第1章 投资组合理论与应用	1.1 投资组合理论
1.2 投资组合理论的应用	思考与练习	第2章 资产定价理论与应用	2.1 资本资产定价模型	
2.2 资产定价理论的应用	思考与练习	第3章 投资组合管理	3.1 投资组合构建与调整的合理性评价	
3.2 积极组合管理的实施		3.3 积极组合管理能力评价	3.4 组合构建合理性对投资绩效的影响	
思考与练习	第二篇 资产配置与投资风格管理	第4章 资产配置管理	4.1 资产配置概述	
4.2 战略性资产配置、战术性资产配置及动态资产配置		4.3 资产配置效率与能力	思考与练习	
第5章 投资风格管理	5.1 投资风格分类	5.2 投资风格的选择	5.3 投资风格的衡量	
思考与练习	第6章 资产配置与投资风格对投资绩效的影响	6.1 资产配置对投资收益的影响	6.2 投资风格一致性对投资绩效的影响	
思考与练习	第三篇 风险管理与绩效评价	第7章 投资风险与监控	7.1 投资风险与监控体系	
7.2 操作风险及其管理		7.3 流动性风险管理	思考与练习	
第8章 投资绩效评价	8.1 绩效评价模型	8.2 业绩持续性及其影响因素	思考与练习	
第9章 投资行为管理	9.1 什么是投资行为	9.2 如何度量投资行为	9.3 行为选择对市场的影响	
思考与练习	第四篇 产品管理和股权投资	第10章 产品管理	10.1 国际与国内证券投资基金市场	
10.2 证券投资基金产品的营销		思考与练习	第11章 私募股权投资基金管理	
11.1 私募股权投资概述	11.2 私募股权基金的投资管理程序	11.3 私募股权基金的投资组合设计	11.4 流动性管理	
思考与练习	第五篇 衍生证券投资	第12章 股指期货分析	12.1 股指期货的基础知识	
12.2 股指期货的交易规则		12.3 股指期货的交易策略	思考与练习	
第13章 股票期权分析初步	13.1 股票期权的基础知识	13.2 股票期权的简单投资策略	13.3 ETF期权的交易	
思考与练习	第14章 高级期权投资策略	14.1 对后市看好的投资策略	14.2 对后市看淡的投资策略	
14.3 认为后市大幅波动的投资策略		14.4 认为后市盘整的投资策略	14.5 预期后市小涨或小跌的投资策略	
思考与练习	参考文献			

## <<投资管理>>

### 编辑推荐

《投资管理》为采用的教师提供教辅资源 本课程从投资行为与策略选择、资产配置方式与战略、投资组合构建与动态调整、投资绩效的评估及其影响因素、组合产品设计与管理等方 面，对机构投资者 的投资管理战略、战术及其具体方式进行深入的理论探讨和案例分析.以深入理解并掌握投资管理的相关理论及其实际应用。

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>