

<<组合投资与投资基金管理>>

图书基本信息

书名：<<组合投资与投资基金管理>>

13位ISBN编号：9787504934178

10位ISBN编号：7504934178

出版时间：2004-8

出版时间：中国金融出版社

作者：陈伟忠 编

页数：176

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>

<<组合投资与投资基金管理>>

内容概要

本教材系统、全面地介绍了组合投资与证券投资基金的基本概念、组合投资的构建方法、一般的投资理论和规律以及证券投资基金的组织管理、经营管理、风险控制、绩效评估等内容。

本教材在内容组织上突破了以往一般投资学和证券投资学教材的固有形式，深入浅出地阐述了现代投资组合的有关理论和方法，并注重投资组合理论的实际应用；重点介绍了证券投资基金管理的一般性框架和过程，采用了大量的图表、数学公式、案例等辅助形式来帮助读者更好地了解 and 掌握投资的基本原理和方法。

本教材可供高等学校金融专业、投资专业教学使用，也可作为从事资产管理行业的实务工作者及投资基金研究人员的参考用书。

<<组合投资与投资基金管理>>

作者简介

陈伟忠，男，同济大学教授、博士生导师。
1957年出生，江苏无锡人。
1982年1月大学毕业并获理学学士学位。
1984年11月西安交通大学研究生毕业获管理工程硕士学位，同时留校任教。
1997年在西安交通大学获管理学博士学位。
历任西安交通大学管理学院技术经济教研室、应用经济

<<组合投资与投资基金管理>>

书籍目录

第一章 投资的收益与风险 第一节 投资收益的概念与特征 一、投资收益的概念与计量 二、投资收益的不确定性 第二节 投资风险 一、投资风险的度量 二、投资风险的概念 三、风险态度与决策 第三节 投资组合的收益与风险 一、组合投资的概念 二、组合投资的风险 三、投资组合的风险分散功效第二章 投资组合的构建 第一节 投资哲学与资产配置政策 一、投资哲学 二、资产配置 第二节 投资组合的构建 一、投资分析 二、资产配置第三章 投资组合的选择与优化方法 第一节 马柯维茨的组合选择方法 一、投资组合优化或选择的概念 二、组合选择的均值/方差法 第二节 风险资产与卖空 一、无风险资产存在情况下的投资组合选择 二、卖空对组合投资的影响 第三节 关于均值/方差法应用的讨论 一、正确认识不确定性决策问题的复杂性 二、均值/方差模型在资产配置中最有效 三、有效运用均值/方差理论和模型的前提条件 四、正确认识理论和模型的作用第四章 组合构建的实用方法 第一节 市场指数模型与投资组合构建 一、市场指数模型 二、基于市场指数模型的组合构建方法 第二节 多指数模型与最优组合构建 一、多指数模型 二、基于市场指数模型的投资组合选择与优化 三、应用说明第五章 衍生工具与投资组合保险 第一节 金融期货与组合投资策略 一、利用利率期货对冲利率风险 二、利用股票期货套期保值 第二节 金融期权与投资组合保险 一、期权的基本概念 二、保护性卖权策略 三、指数期权与组合保险第六章 投资基金概论第七章 投资基金的组织管理第八章 投资基金的经营与管理第九章 投资基金的风险管理与控制第十章 投资基金绩效评估

<<组合投资与投资基金管理>>

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>