

<<投资管理学(第二版)>>

图书基本信息

书名：<<投资管理学(第二版)>>

13位ISBN编号：9787505814523

10位ISBN编号：7505814524

出版时间：1999-09

出版时间：经济科学出版社

作者：(美)弗兰克.J.法博齐

译者：周刚/等

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>

<<投资管理学(第二版)>>

内容概要

投资管理学（第二版），ISBN：9787505814523，作者：（美）弗兰克·J.法博齐（Frank J.Fabozzi）著；周刚[等]译

<<投资管理学(第二版)>>

作者简介

<<投资管理学(第二版)>>

书籍目录

- 目录
- 丛书序言
- 中文版序言
- 作者简介
- 原版前言
- 第一篇 背景
- 第一章 导论
- 投资管理过程
- 资金管理行业的结构
- 投资管理中的道德问题
- 本书的内容编排
- 主要术语
- 问题
- 第二章 金融市场与投资概述
- 金融资产
- 金融市场
- 世界普通股市场
- 世界债券市场
- 货币市场
- 期货与期权市场
- 其他市场
- 股票和债券的历史表现
- 交易机制概述
- 小结
- 主要术语
- 问题
- 第二篇 投资组合理论与资产定价
- 第三章 投资组合理论
- 若干基本概念
- 衡量投资组合的期望收益率
- 衡量投资组合的风险
- 使用历史数据估计投入要素
- 投资组合的分散化
- 选择风险资产组合
- 小结
- 主要术语
- 问题
- 第四章 资本市场理论与资本资产定价模型
- 资本资产定价模型的假设
- 资本市场理论
- 资本资产定价模型
- 资本资产定价模型的检验
- 理论要点
- 小结
- 主要术语

<<投资管理学(第二版)>>

问题

第五章 其他资产定价模型

布莱克的零贝塔CAPM模型

默顿的多要素CAPM

套利定价理论模型

一些普遍原则

小结

主要术语

问题

第三篇 机构投资者及其目标

第六章 资产/负债管理的一般原则

与投资金融资产有关的风险

负债的性质

资产/负债管理概述

非负债驱动型实体的基准

小结

主要术语

问题

第七章 保险公司

保险行业的基本特点

人寿保险公司

财产与责任保险公司

小结

主要术语

问题

第八章 养老基金和捐赠基金

养老基金

捐赠基金

小结

主要术语

问题

第九章 投资公司

投资公司的类型

基金的结构与费用

资金管理者对基金的利用

基金的目标与政策

监管

管理投资公司

小结

主要术语

问题

第十章 存款机构

存款机构的资产/负债问题

商业银行

储蓄与贷款协会

信用合作社

小结

<<投资管理学(第二版)>>

主要术语

问题

第四篇 普通股分析与投资组合管理

第十一章 股票组合管理概述

积极的投资组合管理概述

市场效率

股票市场指数

流行的股票市场策略以及其表现

消极策略的概述

开发和选择策略过程中要考虑的因素

小结

主要术语

问题

第十二章 基本分析

每股收益分析

盈利能力分析

销售额分析

公司债务分析

现金流量分析

小结

主要术语

问题

MONTICELLO公司

第十三章 预测收益

分析师

收益预测在哪里公布

分析师的收益预测

分析师EPS预测和股票收益率

分析师收益率预测

评价分析师的工作业绩

分析师与资本市场

小结

主要术语

问题

第十四章 股票指数法

股票指数法的动机

选择基准指标

对于构造复制性投资组合的分析

构造有代表性的复制性投资组合的方法

交易成本

与积极股票投资策略的联系

小结

主要术语

问题

第十五章 股利贴现模型

基本股利贴现模型

固定增长模型

<<投资管理学(第二版)>>

三阶段DDM

随机DDM

预期收益率

DDM假设

小结

主要术语

问题

第十六章 股票风格管理

股票风格的种类

风格分类体系

价值型和增长型股票的相对业绩

积极的风格管理

风格指数

小结

主要术语

问题

第十七章 股票组合管理的要素方法

要素模型的种类

要素模型的结果和输入变量

用要素模型构造投资组合

要素模型的收益表现潜力

定价模型如何应用

小结

主要术语

问题

第十八章 股票交易

交易场所

二级股票市场中造市者的作用

二级股票市场中的政府干预

订单种类

交易所对于卖空交易的限制

保证金要求

对机构投资者的特殊交易安排

交易成本

小结

主要术语

问题

第十九章 投资管理中股票指数期货的应用

期货合约

股票指数期货合约

期货合约的定价

应用

小结

主要术语

问题

第二十章 在投资管理中股票期权的应用

交易所交易期权与场外市场交易期权

<<投资管理学(第二版)>>

期权和期货合约的区别

股票期权的基本特征

期权的价格

期权的风险与收益特性

期权策略

小结

主要术语

问题

第二十一章 股票期权定价模型

卖权 - 买权平价关系

期权定价模型

期权价格对因素变动的敏感性

估计期望的价格波动性

股票期权市场的定价效率

期权复制策略

小结

主要术语

问题

第五篇 固定收入证券分析与投资组合管理

第二十二章 固定收入证券

债券基础知识

美国政府证券

联邦机构证券

公司债券

债券的安全性

市政证券

欧洲债券

优先股

抵押和抵押支持证券

资产支持证券

小结

主要术语

问题

第二十三章 债券定价

债券的定价

常用的收益率衡量方法

投资组合收益率的衡量

总收益率

小结

主要术语

问题

第二十四章 债券价格的波动性

影响债券价格波动性的因素

价格波动性的衡量

小结

主要术语

问题

<<投资管理学(第二版)>>

第二十五章 影响债券收益率的因素

基础利率

风险补偿

利率的期限结构

小结

主要术语

问题

第二十六章 对含有嵌入期权债券的估价

可提前赎回债券

可转换证券

小结

主要术语

问题

第二十七章 债券组合管理策略

积极的组合策略

债券指数化策略

小结

主要术语

问题

第二十八章 负债融资策略

免疫投资组合以偿付一种单一债务

创建一种组合以偿付多种债务

负债融资策略的推广

积极的策略与免疫策略的结合

小结

主要术语

问题

第二十九章 在投资管理中应用利率期权与期货

利率期货和远期合约

利率期权

小结

主要术语

问题

第三十章 在投资管理中使用互换 上限期权和下限期权

利率互换

股票互换

利率协议(上限期权和下限期权)

股票上限期权和下限期权

小结

主要术语

问题

第六篇 资产分配与业绩评估

第三十一章 资产分配

政策性资产分配

动态资产分配

战术性资产分配

资产分配优化模型

<<投资管理学(第二版)>>

利用衍生产品促进资产分配决策

小结

主要术语

问题

第三十二章 衡量业绩

衡量收益的各种方法

AIMR业绩提交标准

小结

主要术语

问题

第三十三章 评估业绩

基准投资组合

评估业绩的单一指数

股票业绩归属模型

固定收入业绩归属模型

使用夏普基准进行业绩评估

小结

主要术语

问题

附录A 统计概念

概率理论

回归分析

相关性分析

小结

主要术语

问题

附录B 对损益表与资产负债表的回顾

分析公司时所能获得的信息来源

审计师的职能

损益表

资产负债表分析

小结

主要术语

问题

术语汇编

主题索引

译者后记

<<投资管理学(第二版)>>

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>