

<<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，对出题思路和方向有独到把握。

<<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

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>