

<<投资风险管理>>

图书基本信息

书名：<<投资风险管理>>

13位ISBN编号：9787561528723

10位ISBN编号：7561528728

出版时间：2007-12

出版时间：厦门大学

作者：朱平辉

页数：210

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>

## <<投资风险管理>>

### 内容概要

在学习投资风险管理之前，读者如果已学习过投资经济学、证券投资学、项目评估等课程，并有一定的数理基础，会给学习《投资决策分析系列教材：投资风险管理》带来一定的方便。

但是，即使没有学习过以上课程，只要有足够的耐心，读者也能阅读《投资决策分析系列教材：投资风险管理》并且大体上掌握《投资决策分析系列教材：投资风险管理》的内容。

因为风险管理理论与技术都是人们生活中处置风险事件的经总结，一般人都有类似的生活阅历，它并不是高深莫测的抽象道理。

熟练掌握风险管理的技术，当然需要相应的数量分析，我们在附录中罗列了直接相关的数学知识，就是为了方便读者随时翻阅。

“投资组合保险”主要是机构投资者在投资风险管理中使用的策略，它涉及较为复杂的数学模型，该章我们加了星号，作为选学内容。

## &lt;&lt;投资风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

总序前言第一章 总论第一节 投资风险及其分类第二节 风险管理思想的演变第三节 风险管理的新观念  
第二章 预期收益与风险第一节 投资者的风险态度与无差异曲线第二节 有效边界与最优组合第三节 预期收益与风险的关系第三章 传统投资风险管理及套期保值第一节 传统投资风险管理方法概述第二节 套期保值的原理第三节 套期保值方法的应用第四章 VaR技术简介第一节 VaR法的基本原理第二节 VaR的估计方法第三节 VaR的应用第五章 投资组合的VaR第一节 投资组合的VaR第二节 利用EXCEL计算VaR组合与分解第三节 巴林银行为什么会突然破产？  
第六章 债券投资风险与控制第一节 债券市场、利率和类型第二节 债券的收益与风险第三节 债券投资风险的管理与控制第七章 外汇投资风险与控制第一节 外汇与外汇市场第二节 外汇汇率第三节 外汇投资收益与风险管理第八章 股票投资风险及其管理第一节 股票投资第二节 股票投资的风险分析第三节 股票投资管理策略与风险控制第九章 期货投资风险及其控制第一节 期货投资基础知识第二节 期货的定价及风险评估第三节 期货投资及其风险管理第四节 股指期货及其在股票市场风险管理中的应用第十章 投资组合保险的理论及应用第一节 投资组合保险的基本概念第二节 投资组合保险策略第三节 投资组合保险策略的应用第十二章 项目投资风险的评估第一节 项目投资及其评价第二节 投资风险评估第十三章 项目投资风险的管理与控制第一节 项目风险管理的基本问题第二节 投资前时期的风险管理第三节 投资执行期的风险管理第四节 生产运行期的风险管理附录 相关基础知识第一节 函数的导数第二节 向量与矩阵第三节 统计学基础参考文献

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>