

## <<证券组合投资理论及实证分析>>

### 图书基本信息

书名：<<证券组合投资理论及实证分析>>

13位ISBN编号：9787810544573

10位ISBN编号：7810544578

出版时间：2000-01

出版时间：东北大学出版社

作者：马树才

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>

# <<证券组合投资理论及实证分析>>

## 书籍目录

### 目录

#### 序

#### 第1章 证券投资的收益与风险

##### 1.1 证券投资的收益与风险

##### 1.2 证券投资收益分布的

##### 正态性、平稳性

##### 1.3 收益与风险的估算

##### 1.4 证券间的关联性及其估算

#### 第2章 证券组合投资的收益与风险

##### 2.1 证券组合投资的收益与风险

##### 2.2 证券组合投资风险分散效应

##### 2.3 两种证券组合投资的可行集

##### 与有效边界

##### 2.4 证券组合投资的可行集

##### 与有效边界

#### 第3章 证券组合投资模型及其估计

##### 3.1 Markowitz模型及其估计

##### 3.2 Sharpe模型及其估计

##### 3.3 多指数模型及其估计

##### 3.4 多指数因子分析模型

#### 第4章 证券组合投资有效边界的计算

##### 4.1 Markowitz模型有效边界

##### 的计算

##### 4.2 Sharpe模型有效边界的计算

##### 4.3 不变相关模型有效边界的计算

#### 第5章 效用分析与证券组合投资选择

##### 5.1 效用与效用函数

##### 5.2 效用期望分析

##### 5.3 投资者的无差异曲线

##### 5.4 证券组合投资选择程序

#### 第6章 资本资产定价模型 (CAPM)

##### 6.1 证券组合投资与CAPM模型

##### 的假设条件

##### 6.2 标准资本资产定价模型

##### 6.3 非标准资本资产定价模型

#### 第7章 资本资产定价模型的实证检验

##### 7.1 CAPM模型的事后检验法

##### 7.2 Roll对CAPM模型实证检验

##### 的评价

##### 7.3 上海股市CAPM的实证检验

##### 及分析

##### 7.4 深圳股市CAPM的实证检验

##### 及分析

#### 第8章 证券组合投资决策与评价

##### 8.1 证券特征线

## <<证券组合投资理论及实证分析>>

8.2 证券组合投资决策

8.3 证券组合投资实绩的评价

第9章 套利定价理论 (APT)

9.1 套利定价模型

9.2 套利定价模型的估计

9.3 套利定价模型的实证检验

9.4 上海、深圳股市APT的实证检验  
及分析

9.5 套利定价模型的应用

第10章 证券投资市场的有效性

10.1 证券投资市场有效性概念

10.2 证券投资市场有效性的检验

10.3 中国证券投资市场的有效性

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>