

<<投资组合管理>>

图书基本信息

书名：<<投资组合管理>>

13位ISBN编号：9787810983129

10位ISBN编号：7810983121

出版时间：2005-8

出版时间：上海财经大学出版社

作者：曹志广 等

页数：299

字数：288000

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>

<<投资组合管理>>

内容概要

本书适用于经济、管理、金融专业及商学院高年级本科生和研究生的教学。

对于那些渴将所学的理论运用到工作中去的实际工作者，本书也非常适合。

本书详尽地对投资组合管理的基础理论进行了介绍，并且应用MATLAB6.5实现了与投资组合理论及应用有关的大部的金融计算，这使得学生和实际工作者能够将理论应用到实践中去。

本书尽量简化了繁琐的数学推导，并将繁重的金融计算尽量通过编写MATLAB函数或文件来实现，这是本书与其他书的最大区别。

本书适用于经济、管理、金融专业及商学院高年级本科生和研究生的教学。

书籍目录

总序前言第一章 证券组合管理概述 第一节 证券组合的基本概念 一 证券投资的收益和风险 二 证券组合的意义与分类 三 证券组合的管理内容 四 现代证券组合管理的适用范围 五 统计与证券管理的关系 第二节 现代证券组合理论的内容 一 马柯威茨的均值方差模型 二 托宾的收益风险理论 三 夏普的单因素模型 四 夏普、林特纳与莫辛对资本资产定价模型的贡献 五 套利定价理论 复习思考题 第二章 基本的均值方差模型 第一节 证券组合的收益与方差 一 证券组合的收益 二 证券组合的预期收益 三 单一证券投资风险的度量 四 证券之间的关联性 五 证券组合风险的度量 第二节 证券组合及其可行域 一 不允许卖空时,两种证券的投资组合 二 不允许卖空时,多种证券组合的可行域 第三节 有效边界的确定 一 有效边界的概念 二 不允许卖空时,有效边界的确定 三 允许卖空时,多种风险证券组合的有效边界 四 有效边界的凹性 第四节 效用分析与最优证券组合 一 效用 二 效用函数 三 期望效用函数 四 无差异曲线 五 最优证券组合的选择 第五节 包含无风险借贷的扩展模型 一无风险证券 二 无风险证券与单个风险证券的组合 三 包容无风险贷出的模型 四 包容无风险借入的模型 复习思考题 第三章 简化的证券组合选择模型 第四章 资本市场均衡模型 第五章 有效市场假说 第六章 债券投资 第七章 股票投资 第八章 衍生证券投资参考文献

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>