

<<金融投资学>>

图书基本信息

书名：<<金融投资学>>

13位ISBN编号：9787302277170

10位ISBN编号：7302277176

出版时间：2012-1

出版时间：清华大学出版社

作者：朱顺泉

页数：329

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>

## &lt;&lt;金融投资学&gt;&gt;

## 内容概要

《普通高校“十二五”规划教材·金融学系列·金融投资学：理论·应用·实验》内容包括：  
(1) 投资环境及其内容；(2) 证券交易与基金；(3) 投资收益与风险；(4) 最优投资组合与有效边界；(5) 投资组合优化模型及其应用；(6) 指数模型及其应用；(7) 资本资产定价模型及其应用；(8) 套利定价理论及其应用；(9) 证券收益的实证依据与有效市场假说；(10) 固定收益证券定价与风险管理；(11) 股权估价模型与证券分析；(12) 期权与二项式期权定价模型及其应用；(13) Black-Scholes期权定价模型与应用；(14) 期货合约及其套期保值；(15) 投资组合绩效评价与投资组合策略；(16) 金融投资学计算实验。

《普通高校“十二五”规划教材·金融学系列·金融投资学：理论·应用·实验》内容新颖、全面，实用性强，融理论、方法、应用、实验于一体，是一部供金融学、金融工程、投资学、保险学、经济学、财务管理、会计学、MBA等专业的本科高年级学生与研究生使用的教材或参考书。

## &lt;&lt;金融投资学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 金融投资学导论第1章 投资环境及其内容1.1 投资与投资学1.2 实物资产和金融资产1.3 金融资产分类与金融市场、金融机构1.3.1 金融资产分类1.3.2 金融市场1.3.3 金融市场的参与者（或金融系统的主体或客户）1.3.4 金融机构及其产品1.4 投资的市场原则1.5 投资环境的变化趋势1.6 现代投资理论内容简述1.6.1 投资组合理论1.6.2 资本资产定价模型1.6.3 套利定价理论1.6.4 有效市场假说1.6.5 固定收益证券1.6.6 布莱克 - 斯科尔斯的期权定价理论1.6.7 二项式期权定价理论1.6.8 投资组合绩效评价及其应用思考题第2章 证券交易与基金2.1 证券交易原则与指令2.1.1 交易优先的原则2.1.2 指令的类型2.2 保证金账户2.3 卖空2.4 交易成本2.5 证券市场监管2.5.1 美国政府对证券市场的管理2.5.2 我国现行证券监管体制2.6 股票指数2.7 基金思考题第二篇 投资组合理论与应用第3章 投资收益与风险3.1 持有期收益率3.2 资产的期望收益率（期望）3.3 资产的风险（方差）3.4 期望和方差的统计估计量3.5 资产之间的协方差与相关系数3.6 下半方差3.7 绝对偏差3.8 风险价值3.9 条件风险价值3.10 投资组合的期望收益和标准差3.11 资产或资产组合的报酬—风险比率（夏普比率）3.12 效用函数及其应用3.12.1 效用函数的含义3.12.2 凹性效用函数——厌恶风险3.12.3 凸性效用函数——喜好风险3.12.4 中性效用函数3.12.5 效用函数的讨论3.12.6 均值方差的效用函数3.12.7 无差异曲线（簇）思考题……第三篇 均衡资本市场第四篇 固定收益证券第五篇 权益证券的做人方法与证券分析第六篇 金融衍生证券第七篇 投资组合管理第八篇 实验参考文献

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>