

<<现代投资组合理论与投资分析>>

图书基本信息

书名：<<现代投资组合理论与投资分析>>

13位ISBN编号：9787111212041

10位ISBN编号：7111212045

出版时间：2007-3

出版时间：机械工业

作者：埃尔顿

页数：731

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>

<<现代投资组合理论与投资分析>>

内容概要

本书讲述了现代投资组合理论与投资分析。

全书分为五大部分，包括：导言、投资组合分析、资本市场均衡模型、证券分析和投资组合理论、投资过程评价。

本书是最新的第7版，在这一版中几乎所有的章节都重新修订过，有实质性南变化。

新增了涉及行为金融的第20章和涉及期望回报估计的第10章，第6版中涉及效用分析和其他选择准则内容的两章都彻底重新撰写，并被归入本书涉及最优投资组合选择替代方法的第11章，此外，还增加了关于在险价值和模拟应用的新内容。

其他一些章也有实质性的修订，包括第15、16章关于多指数模型和资本资产定价模型检验的内容，第25章新增了关于共同基金的新内容。

本书不仅可作为MBA、研究生、本科生投资学课程的教材，还可作为证券分析师和投资组合管理人的培训教材。

本书的写作坚持能够让读者理解的原则，强调理论背后的直观经济含义，超过初等代数的数学证明被置于注释；附录和特别说明部分，略过这些不影响对主题的理解。

在每章还设有思考与练习。

本书努力体现现代投资组合分析、一般均衡理论和投资分析的前沿，并且用容易理解和直观的形式表现出来。

本书在编排上努力使各章内容以可变顺序使用的方式组织，便于不同学习方法和学习水平的读者学习。

。

<<现代投资组合理论与投资分析>>

作者简介

埃协温J.埃尔顿是纽约大学Stern商学院的Nomura金融学教授。他已经独立或与他人合作出版了8本书，并发表了100多篇论文，这些论文发表在诸如The Journal of Fiance, The Review of Financial Studies, Review of Economics and Statitics, Management Science, Journal of Financia

<<现代投资组合理论与投资分析>>

书籍目录

序推荐序作者简介前言第一部分 导言 第1章 导言 第2章 金融证券 第3章 金融市场第二部分
投资组合分析 部分1 均值方差投资组合理论 第4章 风险条件下机会集的特征 第5章 有
效投资组合的描述 第6章 有效边界的计算方法 部分2 投资组合选择过程的简化 第7章 证
券回报的相关结构：单指数模型 第8章 证券回报的相关结构：多指数模型和分群技术 第9章
确定有效边界的简单技术 部分3 最优投资组合选择 第10章 期望回报的估计 第11章 在
有效机集中如何选择的投资组合 部分4 扩展选择空间 第12章 国际化分数第三部分 资本市场
均衡模型 第13章 标准资本资产定价模型 第14章 非标准形式的资本定价模型 第15章 均衡
模型的实证检验 第16章 套利定价模型APT：解释资产价格第四部分 证券分析和投资组合理论
第17章 有效市场 第18章 估值过程 第19章 盈利估计 第20章 行为金融、投资者决策和资产
定价 第21章 利率理论和债券定价 第22章 债券投资组合管理 第23章 期权定价理论 第24章
金融期货的估价与应用第五部分 投资过程评价 第25章 投资组合业绩评价 第26章 证券分析
的评价 第27章 投资组合管理的回顾

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>