

<<投资科学>>

图书基本信息

书名：<<投资科学>>

13位ISBN编号：9787300058801

10位ISBN编号：7300058809

出版时间：2004-9

出版时间：中国人民大学出版社

作者：卢恩伯格 (LuenbergerDavidG.)

页数：494

字数：739000

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;投资科学&gt;&gt;

## 内容概要

斯坦福大学知名教授卢恩伯格所著的《投资科学》与滋维·博迪等人所著的《投资学》和威廉·夏普等人所著的《投资学》一样，是国内外读者非常喜欢的投资学教材。

本书英文影印版的出版使中国读者可以品读到原汁原味的内容。

与后两本书相比，本书的主要特点在于：本教材内容并不是像一般的投资学教材内容包罗万象，而是从理论联系实际出发，系统地论述金融市场资产定价的基本理论和方法，更凸现了期权和期货等衍生证券的基本理论在教材中的重要地位。

更难能可贵的是，教材自始至终用众多实例和图形论述各种金融问题，既形象直观又通俗易懂。

需要指出的是，特别突出资产定价理论的数值计算方法，如二项式网格方法，这是一般投资学教材所忽视的，而本书却给予了足够的重视。

通过各种各样丰富多彩的例子研究了实物期权等更一般的投资问题，这是本书的又一亮点，因为实物期权是当前金融领域的研究热点之一。

同时，本书还系统地论述了对数最优策略在资产定价和投资组合决策等领域中的重要作用。

全书共分四部分，16章。

其中第一部分论述确定性现金流，第二部分论述单期随机现金流，如固定收益证券理论和单期资产定价理论等。

第三部分论述期权和期货等衍生证券理论，第四部分论述一般现金流问题。

本书可作为我国高等学校经济、管理类专业“投资学”的教材和参考书，也可作为广大经济金融从业人员、各级经济金融管理人员学习现代投资学基础理论和方法的合适的辅导书。

## 作者简介

卢恩伯格教授于1963年毕业于斯坦福大学并获得博士学位，现为斯坦福大学管理科学与工程学院教授

他还是经济计量学会、经济动态与控制学会、经济理论推广协会的会员。

他已经出版的主要著作有：《动态系统导论：理论、模型与应用》（Introduction to dynamic systems : Theory ,

## &lt;&lt;投资科学&gt;&gt;

## 书籍目录

1. 引言 1.1 现金流 1.2 投资和市场 1.3 典型的投资问题 1.4 本书的组织结构第一部分 确定性的现金流 2. 利息的基本理论 2.1 本金和利息 2.2 现值 2.3 现金流的现值和终值 2.4 内部收益率 2.5 评估准则 2.6 应用和扩展 \* 2.7 小结 练习 参考文献 3. 固定收益证券 3.1 未来现金流的市场 (the market for future cash) 3.2 价值公式 3.3 债券的详细介绍 (details of bond) 3.4 收益 3.5 久期 3.6 免疫 3.7 凸度 3.8 小结 练习 参考文献 4. 利率的期限结构 4.1 收益曲线 4.2 期限结构 4.3 远期利率 4.4 对期限结构的几种解释 4.5 期望动态 4.6 running present value 现值 4.7 浮动利率债券 4.8 久期 4.9 免疫 4.10 小结 练习 参考文献 5. 应用利率分析 5.1 资本预算 5.2 最优资产组合 5.3 动态现金流过程 5.4 最优管理 5.5 和谐定理 \* 5.6 公司的估值 \* 5.7 小结 练习 参考文献第二部分 单期随机现金流 6. 均值-方差资产组合理论 6.1 资产收益 6.2 随机变量 6.3 随机收益 6.4 资产组合 (期望收益) 均值和方差 6.5 可行集合 6.6 马格维茨模型 6.7 两个资金定理 \* 6.8 包含一个无风险资产的投资组合 6.9 单资金定理 练习 参考文献 7. 资本资产定价模型 8. 模型和数据第三部分 10. 远期、期货和掉期 11. 资产动态的模型 12. 基本期权理论 13. 其他期权问题 14. 利率衍生品第四部分 一般现金流 15. 最优化资产组合增长 16. 一般投资评估 general investment evaluation 附录A 基本概率理论 A1 一般概念 A2 正态随机变量 A3 对数正态随机变量 附录B 微积分和最优化 B1 函数 B2 差额微积分 B3 最优化 练习答案索引

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>