

<<投资学原理与应用>>

图书基本信息

书名：<<投资学原理与应用>>

13位ISBN编号：9787302125167

10位ISBN编号：7302125163

出版时间：2006-3

出版时间：清华大学出版社

作者：朱顺泉

页数：135

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>

<<投资学原理与应用>>

内容概要

本书的主要内容包括：（1）现代投资理论的简要描述；（2）投资分析的统计方法；（3）Markowitz的投资组合理论；（4）投资组合优化模型及其应用；（5）资本资产定价模型（CAPM）及其应用；（6）套利定价理论（APT）及其应用；（7）Black-Scholes看涨（看跌）期权定价模型的推导；（8）Black-Scholes期权定价模型的计算程序与应用；（9）二项式期权定价模型及其计算程序与应用；（10）证券投资分析的因子模型及其应用。

本书是一本供金融工程、财务管理、会计学、金融学、统计学、管理科学、应用数学、数量经济学等专业的本科高年级与研究生使用的教材或参考书。

<<投资学原理与应用>>

书籍目录

第1章 投资理论概述1.1 组合投资理论1.2 资本资产定价模型1.3 套利定价理论1.4 期权定价理论
第2章 投资收益与风险的统计分析2.1 均值与方差2.2 市场投资组合、特征线2.3 B因子第3章 投资组合理论3.1 投资组合的收益与风险3.2 组合线3.3 最小方差集合与有效集合3.4 单指数模型3.5 多指数模型第4章 投资组合优化模型及其应用4.1 单项投资的期望回报率与风险4.2 一组投资(即多项投资)的期望回报与风险4.3 期望值、方差、均方差和相关系数的计算4.4 投资组合优化模型与应用第5章 资本资产定价模型及其应用5.1 资本资产定价模型假设条件5.2 夏普资本资产定价模型5.3 林特纳资本资产定价模型5.4 资本市场线与证券市场线的关系5.5 在资本资产定价模型中特征线的定位5.6 单个证券在 $E(r)-a(r)$ 平面中的位置5.7 资本资产定价模型及其应用第6章 套利定价理论及其应用6.1 套利的概念6.2 单因子模型6.3 多因子模型6.4 套利定价理论的应用6.5 套利定价理论的进一步讨论第7章 Black-Scholes期权定价模型7.1 期权7.2 期权定价7.3 随机游动与Brown运动7.4 二次变差定理7.5 伊藤(Ito)公式的推导7.6 Black-Scholes期权定价模型的历史7.7 Black-Scholes方程7.8 Black-Scholes欧式看涨期权定价公式的推导7.9 Black-Scholes欧式看涨期权定价公式的应用7.10 Black-Scholes欧式看跌期权定价公式的推导7.11 期权的衍生物第8章 Black-Scholes期权定价公式的计算与应用8.1 Black-Scholes期权定价公式8.2 运用VBA定义Black-Scholes期权定价函数8.3 股票收益率的波动率的计算8.4 运用二分法VBA函数计算隐含波动率8.5 运用科拉多-米勒公式计算隐含波动率8.6 运用牛顿法计算隐含波动率第9章 二叉树(二项式)期权定价模型及其应用9.1 引言9.2 单期的二叉树(二项式)期权定价模型9.3 购买选择权价格与套利过程9.4 两期与多期的二项式模型9.5 二项式期权定价模型应用实例9.6 二项式期权定价模型与Black-Scholes模型比较9.7 二项式期权定价模型的计算程序及应用第10章 证券投资分析的因子模型及其应用10.1 上市公司评价指标体系的建立10.2 因子分析的基本原理10.3 应用因子模型进行证券投资分析的基本步骤10.4 证券投资因子模型的实证分析参考文献

<<投资学原理与应用>>

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>