

<<破解CFA定量方法>>

图书基本信息

书名：<<破解CFA定量方法>>

13位ISBN编号：9787509531013

10位ISBN编号：7509531012

出版时间：2012-1

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：林晨雷

页数：174

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>

<<破解CFA定量方法>>

内容概要

这套指导考试用书的目标在于，用最简单有效的逻辑把CFA考点串起来，用最浅显的语言把CFA考点讲清楚，再用配套的习题使得考生牢固掌握知识点。

经笔者多年培训实践，这是唯一行之有效的方法。

不少学员听完笔者的课程之后，认为笔者所说简单易学。

有几位学员在上了笔者二级定量方法中时间序列分析的课程之后，强烈建议笔者把它们写作成书，以解决更多学员的疑惑。

正是出于对考生负责的初衷，才有了这套书的问世。

笔者因为自己多年的CFA培训经历，对考生们的心理以及在复习中遇到的困难有着深刻的了解，才不揣浅陋，贸然将课堂上的一些教学心得付梓，也敢于挑战市面上一些权威的错误思想。

<<破解CFA定量方法>>

作者简介

林晨雷，CFA持证人，香港财经分析师学会会员，欧盟中国经理人协会（FLJCMA）会员。自2004年开始即主讲CFA、FRM及CFP课程，在金融数量分析、投资组合管理、金融衍生产品、固定收益证券、另类投资等方面拥有多年培训实战经验。曾为工商银行总行、中国银行总行、交通银行总行、中国邮政集团、中投证券、大都会人寿等诸多机构提供内部培训。曾编著多本CFA教材，也是CFA试题研究专家，三级考试均一次通过，对出题思路 and 方向有独到把握。

<<破解CFA定量方法>>

书籍目录

第一部分 CFA一级定量方法

第一章 货币时间价值

现值和终值

有效年利率

年金

永续年金

不规则现金流

复杂的货币时间价值题目

第二章 现金流折现的应用

净现值

内部收益率

时间加权收益率和货币加权收益率

几种收益率的度量

第三章 数理统计基础

统计的目的

总体和样本

四种度量尺度

频度分布

中心趋势的度量

离散程度的度量

切比雪夫不等式

夏普比率

偏度

峰度

第四章 概率论基础

基本概念

概率基本性质

三种概率

赔率

乘法法则和加法法则

全概率法则

随机变量的期望值和方差

两个随机变量的协方差和相关关系

贝叶斯公式

计数问题

第五章 常见概率分布

基本概念

离散分布

连续分布

对数正态分布

蒙特卡洛模拟和历史模拟

第六章 抽样和估计

基本概念

简单随机抽样和分层随机抽样

抽样误差和抽样分布

<<破解CFA定量方法>>

中心极限定理

五种偏差

第七章 假设检验和置信区间估计

第八章 技术分析

第二部分 CFA二级定量方法

<<破解CFA定量方法>>

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>