

<<证券组合投资理论及实证分析>>

图书基本信息

书名：<<证券组合投资理论及实证分析>>

13位ISBN编号：9787810544573

10位ISBN编号：7810544578

出版时间：2000-01

出版时间：东北大学出版社

作者：马树才

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>

<<证券组合投资理论及实证分析>>

书籍目录

目录

序

第1章 证券投资的收益与风险

1.1 证券投资的收益与风险

1.2 证券投资收益分布的

正态性、平稳性

1.3 收益与风险的估算

1.4 证券间的关联性及其估算

第2章 证券组合投资的收益与风险

2.1 证券组合投资的收益与风险

2.2 证券组合投资风险分散效应

2.3 两种证券组合投资的可行集

与有效边界

2.4 证券组合投资的可行集

与有效边界

第3章 证券组合投资模型及其估计

3.1 Markowitz模型及其估计

3.2 Sharpe模型及其估计

3.3 多指数模型及其估计

3.4 多指数因子分析模型

第4章 证券组合投资有效边界的计算

4.1 Markowitz模型有效边界

的计算

4.2 Sharpe模型有效边界的计算

4.3 不变相关模型有效边界的计算

第5章 效用分析与证券组合投资选择

5.1 效用与效用函数

5.2 效用期望分析

5.3 投资者的无差异曲线

5.4 证券组合投资选择程序

第6章 资本资产定价模型 (CAPM)

6.1 证券组合投资与CAPM模型

的假设条件

6.2 标准资本资产定价模型

6.3 非标准资本资产定价模型

第7章 资本资产定价模型的实证检验

7.1 CAPM模型的事后检验法

7.2 Roll对CAPM模型实证检验

的评价

7.3 上海股市CAPM的实证检验

及分析

7.4 深圳股市CAPM的实证检验

及分析

第8章 证券组合投资决策与评价

8.1 证券特征线

<<证券组合投资理论及实证分析>>

8.2 证券组合投资决策

8.3 证券组合投资实绩的评价

第9章 套利定价理论 (APT)

9.1 套利定价模型

9.2 套利定价模型的估计

9.3 套利定价模型的实证检验

9.4 上海、深圳股市APT的实证检验
及分析

9.5 套利定价模型的应用

第10章 证券投资市场的有效性

10.1 证券投资市场有效性概念

10.2 证券投资市场有效性的检验

10.3 中国证券投资市场的有效性

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>