

<<投资学>>

图书基本信息

书名：<<投资学>>

13位ISBN编号：9787810984751

10位ISBN编号：7810984756

出版时间：2005-10

出版时间：上海财经大学出版社

作者：范龙振

页数：246

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>>

### 内容概要

本书根据金融工程或金融学专业教学对投资学这门课程的定位，结合中国资本市场的当前状况，着重从理论上介绍了资产组合理论、资本资产定价模型、一般定价模型——随机贴现因子定价模型、套利定价模型、资本市场效率理论、利率期限结构的决定因素和利率模型等。

投资学不仅能使读者掌握金融理论，而且能够使读者学会利用这些理论分析资本市场，通过资本市场检验发展金融资产定价理论。

因此，本书对各个定价理论都介绍了有关的实证分析方法，包括已有的实证分析结果。

本书还讨论了两个重要的但相对有一定难度的实证分析方法：广义矩估计方法和卡尔曼滤波法。

本书的另一个特点是加入了很多中国资本市场的实证分析内容，包括中国股票市场的实证分析，中国债券市场表现出的利率期限结构的实证分析，中国回购市场的投资策略等。

通过这些分析，一方面可以了解到一些实证分析方法，理解金融理论；另一方面还可以深入认识中国资本市场。

## 书籍目录

总序前言第一章 投资学的基本概念 第一节 金融市场 第二节 金融市场的功能 第三节 资产定价理论 第四节 投资者的效用函数与风险厌恶程度 第五节 资本市场的基本特征分析 思考题 参考文献第二章 现代资产组合理论 第一节 资产的回报和风险 第二节 风险分散化 第三节 效用函数的估计与均值方差分析 第四节 均值方差前沿的性质 第五节 包含无风险资产的投资组合的最小方差前沿 第六节 效用最大化与均值方差分析 第七节 高阶距的影响 思考题 参考文献第三章 资本资产定价模型 第一节 资产组合理论的回顾 第二节 资本资产定价模型的导出 第三节 资本资产定价模型的应用 第四节 资本资产定价模型的实证 思考题 参考文献第四章 随机贴现因子定价模型 第一节 消费为基础的资本资产定价模型 第二节 随机贴现因子模型与无风险利率的决定因素 第三节 风险与资产的价格 第四节 资产组合的均值方差前沿 第五节 随机贴现因子与资产价格的动态变化 第六节 随机贴现因子定价模型与线性因子定价模型 第七节 资本资产定价模型与随机贴现因子定价模型 第八节 跨期资本资产定价模型 (ICAPM) 和套利定价模型 思考题 参考文献第五章 资本市场效率与资本市场实证分析第六章 广义矩估计方法第七章 股票市场的实证分析结果第八章 预期、风险、风险厌恶与利率期限结构的形状第九章 卡尔曼滤波法及其在利率模型估计中的应用第十章 Vasicek模型第十一章 债券的投资与风险管理策略

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>