

《金融资产风险与定价》

图书基本信息

书名：《金融资产风险与定价》

13位ISBN编号：9787111487885

出版时间：2015-1

作者：韩立岩,部慧

页数：300

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《金融资产风险与定价》

内容概要

韩立岩、部慧编著的《金融资产风险与定价(理论篇)》属于中高级投资学层次，紧扣均衡定价与风险管理的主线，突出资本资产定价模型、套利定价模型和期权定价模型三个支点，从历史的视角、均衡的视角、风险回报的视角以及中国元素的视角等四个方面突出风险识别与风险溢价的分析思路，突出中国案例。

《金融资产风险与定价》

作者简介

韩立岩，男，北京航空航天大学经济管理学院教授、博导、理学博士。主要研究方向：金融工程、公司金融。享受国务院政府津贴。主持十余项国家与部级基金课题，其中包括两项北京市哲学社会科学规划项目。在国际学术杂志发表论文六篇，在《经济研究》、《管理世界》、《管理科学学报》等国内权威杂志发表论文六十余篇，出版中英文专著五部。获得部级成果奖五项。提出刻画消费升级的发展指数和表示综合汇率的人民币指数。

部慧，北京航空航天大学经济管理学院金融系副教授、管理学博士。

书籍目录

前言

第1章 证券：风险与收益

1.1 证券的金融属性

1.1.1 股票

1.1.2 债券

1.1.3 期货

1.1.4 期权

1.1.5 证券的金融属性

1.2 投资：真实资产与金融资产

1.3 交易机制与监管机制

1.3.1 证券市场的结构

1.3.2 交易系统和运行方式

1.3.3 指令类型和交易所会员类型

1.3.4 保证金交易

1.3.5 金融市场的监管

1.4 做空机制

1.5 证券指数

1.5.1 股票市场指数

1.5.2 债券市场指数

1.5.3 股票-债券综合指数

1.5.4 商品市场指数

1.5.5 市场指数要件

关键术语

扩展阅读

第2章 分散化：风险资产最优组合

2.1 分散化机理

2.1.1 收益与风险的度量

2.1.2 投资组合的收益与风险

2.1.3 多样化与投资组合的风险分散

2.2 均值-方差准则

2.2.1 效用函数

2.2.2 风险厌恶的表达

2.2.3 最大效用原则

2.2.4 风险厌恶程度的度量

2.3 风险资产组合的有效前沿

2.3.1 有效前沿的含义

2.3.2 有效前沿的估计与计算

2.3.3 投资者在有效前沿上的最优风险资产组合

2.3.4 均值-方差前沿组合

2.3.5 存在卖空限制时的有效前沿

2.4 风险价值

2.4.1 下方风险测度与半方差

2.4.2 风险价值的含义与测算

2.4.3 风险价值的应用与存在的问题

2.5 两基金原理

2.5.1 资本配置线

2.5.2 资本市场线

2.5.3 两基金分离定理

关键术语

扩展阅读

第3章 竞争均衡：

3.1 资本资产定价模型：证券市场的一般均衡

3.1.1 资本资产定价模型的思路

3.1.2 市场组合的风险溢价

3.1.3 CAPM的合理性：微观经济学的视角

3.2 证券市场线

.....

第4章 套利均衡与三因素模型

第5章 股票定价

第6章 债券均衡价格

第7章 有效市场假说与投资者行为

第8章 期权定价

第9章 期货均衡定价

第10章 套期保值

后记

《金融资产风险与定价》

精彩短评

- 1、把经典的资产定价理论全面的介绍了一下,对考CFA二级的同学会有很大帮助吧.
- 2、中高级投资学
- 3、非常详细,但是有点难

《金融资产风险与定价》

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:www.tushu000.com