

# 《组合证券投资与资本市场研究》

## 图书基本信息

书名：《组合证券投资与资本市场研究》

13位ISBN编号：9787030195920

10位ISBN编号：7030195922

出版时间：2007-7

出版社：科学出版社

作者：曾勇

页数：301

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](http://www.tushu000.com)

# 《组合证券投资与资本市场研究》

## 内容概要

《组合证券投资与资本市场研究》致力于组合证券投资与资本市场研究。本书共分5章。第1章介绍现代资本市场理论的发展情况及其在投资管理实践中的作用。第2章介绍资本市场理论基础。第3章介绍组合证券投资决策与管理方法方面的研究。第4章介绍证券市场有效性与投资行为研究。第5章介绍集合竞价与连续竞价研究。

# 《组合证券投资与资本市场研究》

## 书籍目录

第1章 现代资本市场理论与投资管理实践1.1 现代资本市场理论的发展1.1.1 资本市场理论的起源1.1.2 现代资本市场理论的发展历程1.1.3 现代资本市场理论的最新发展1.2 现代资本市场理论对投资管理实践的作用1.3 本书内容提要参考文献第2章 资本市场理论基础2.1 证券组合、风险偏好与收益分布特征2.1.1 期望效用函数2.1.2 证券组合2.1.3 风险厌恶2.1.4 随机占优2.2 均值 - 方差组合证券选择理论2.2.1 均值 - 方差偏好2.2.2 均值 - 方差准则与风险分散2.2.3 有效边界2.3 基金分离定理及其扩展2.3.1 两基金分离定理2.3.2 引入指数期货的组合证券选择与基金分离定理2.4 资本资产定价模型2.4.1 资本市场均衡2.4.2 资本资产定价模型的具体形式2.4.3 零价塔资本资产定价模型2.4.4 引入指数期货的资本资产定价模型2.4.5 具有不同持有期限的资本资产定价模型2.5 套利定价理论2.5.1 多因素模型与因素风险2.5.2 套利组合2.5.3 套利定价理论2.5.4 资本资产定价模型与套利定价理论2.6 期权定价理论2.6.1 期权的概念2.6.2 理性期权定价的性质2.6.3 二叉树定价模型2.6.4 BLACK-SCHOLES期权定价模型2.6.5 组合证券2.7 有效市场理论2.7.1 有效市场的基本概念2.7.2 有效市场与理性预期2.7.3 有效市场的检验附录参考文献第3章 组合证券投资决策与管理方法3.1 限制性卖空情况下证券组合有效边界的特征和确定方法3.1.1 限制性卖空情况下证券组合有效边界的特征3.1.2 组合构成和有效边界变动的确定方法3.1.3 小结3.2 市场指数模型下最优证券组合的简化算法3.2.1 EGP算法3.2.2 存在负贝塔系数情况下扩展的EGP算法3.2.3 进一步的推广3.2.4 释例3.2.5 贝塔系数为1条件下的最优证券组合3.2.6 小结3.3 基于斯坦规则的协方差矩阵估计改进的实证研究3.3.1 LEDOIT和WOIF (2003) 的协方差矩阵斯坦规则估计量3.3.2 实证数据及方法3.3.3 实证结果第4章 证券市场有效性与投资者行为第5章 集合竞价与连续竞价交易机制研究

# 《组合证券投资与资本市场研究》

## 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](http://www.tushu000.com)