

《投资组合理论与资本市场》

图书基本信息

书名：《投资组合理论与资本市场》

13位ISBN编号：9787111546296

出版时间：2016-9

作者：（美）威廉 F. 夏普（William F. Sharpe）

页数：320

译者：郑磊

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

《投资组合理论与资本市场》

内容概要

自从威廉 F. 夏普在20世纪60年代早期的博士论文题目中提出创意以来，资本资产定价模型（CAPM）便成为现代投资理论的核心。通过解释每一种投资会遭受两种显著的风险——位于市场中的系统性风险和与一个公司命运相关的非系统性风险，CAPM代表了一种数量化的、复杂的但是可以理解的测度与投资者承担风险的收益相关的组合风险的模型。1970年出版的《投资组合理论与资本市场》一书向广泛的读者介绍了CAPM，并且奠定了夏普博士作为金融思想巨人的地位。这是第一本把数个世纪以来的定价和风险知识联系在一起，并以精确、简明易懂且显著有效的方式表述的著作。

《投资组合理论与资本市场》

作者简介

威廉 F. 夏普 (William F. Sharpe)

与哈里·马科维茨 (Harry Markowitz) 和默顿·米勒 (Merton Miller) 由于对资本资产定价模型 (CAPM) 的贡献而共同获得了1990年诺贝尔经济学奖

自1970年始, 夏普博士任教于斯坦福大学, 现在他是斯坦福大学商学院研究生院的金融学名誉教授。

除了资本资产定价模型和为估计投资绩效而被广泛应用的夏普比率外, 他对投资学领域的其他贡献还包括对期权和其他偶发要求权估值的关键性方法, 在资产配置过程中使用的一种计算机方法和估计投资基金类型和绩效的技术。夏普博士的其他著作包括《资产配置工具》《投资学原理》和《投资学》(与戈登 J. 亚历山大 (Gordon J. Alexander) 和杰弗里 V. 贝利 (Jeffery Bailey) 合著)。

他是美国金融学会的前任主席和提供在线投资咨询的金融工程公司的主席。

《投资组合理论与资本市场》

书籍目录

《投资组合理论与资本市场》

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