

投资组合管理



[投资组合管理_下载链接1](#)

著者:小詹姆斯 L.法雷尔

出版者:机械工业出版社

出版时间:2000-3-1

装帧:平装(无盘)

isbn:9787111076827

本书系统论述了全球投资组合领域的深层问题，如CMT，ATP，马考维茨模型及单、多指数模型等最前沿的理论和最新研究成果；对金融期货、期权等衍生证券理论进行了深入剖析；对证券管理中的风险控制等难点及CAMP的实践运用也进行了分析。

作者介绍:

小詹姆斯 L. 法雷尔 (James L. Farred, Jr.)，系美国注册财务分析师 (CFA)，先后

获圣母大学 (the Univerdty of Notre Dame) 学士学位、沃顿大学 (wharton School)

工商管理硕士 (MBA) 学位和纽约大学 (New York University, NYU) 博士学位。

作为证券分析师、财务研究工作者和重要金融机构的投资组合经理三位一体的法雷尔博士已具有25年以上的经历。其间他曾在花旗银行和学院退休权益基金 (CREF) 等工作。法雷尔博士首创了股票选择的基于 α 概念的系统方法，并成功地把以这种方法为基础的战略应用到他于1980年创建的投资咨询公司的工作中。此后法雷尔博士把 α 战略的应用推广到了国际市场。作为Farrell—Wako全球投资管理公司 (FWGI) 的总裁，法雷尔博士正在管理着众多美国国内权益投资组合和外国权益市场的投资组合。

自从1976年以来，法雷尔博士一直担任定量财务学研究所（the Institute for Quantitative Research in Finance）所长一职，该研究所以“Q集团”（Q源于英文定量的Quantitative一词的第一个字母）著称于世。“Q集团”是由投资类型极为广泛的机构所

构成的一种合作型组织，其共同的兴趣是提高并推广投资管理的技术发展水平。‘Q集团’的成员包括投资定量方法这一领域中许多世界领先的实际工作者。‘Q集团’每半年举办一次研讨班，其间实际工作者和学术研究者共同探讨投资的理论和应用方法问题。

法雷尔博士曾兼任著名的纽约大学和哥伦比亚大学（Columbia University）的财务学教授，讲授了关于投资组合管理的许多课程。他撰写并出版了投资组合管理领域的大量著作，涵盖了资产配置、证券估值、投资组合分析和国际投资等论题。法雷尔博士不仅巴α战略成功地运用于投资组合管理，他还把该方法的优点通过论著和讲演广为传播，使投资过程引进了更大的修炼性和结构性。法雷尔博士早期的关于因素分析和同类股票群组方面的研究和著述，领先引发了当代人在权益风格分析领域中的强烈兴趣，这种分析是管理投资组合和评估业绩的一种重要方法。

目录: 第一篇 引论
第二篇 投资组合的构建和分析
第三篇 证券估值和风险分析
第四篇 资产类别管理
第五篇 衍生工具：估值与战略应用
第六篇 投资组合业绩分析
· · · · · (收起)

[投资组合管理_下载链接1](#)

标签

- 金融
- 股市
- 投资
- 财经

投资组合管理

股票

经管

经济

评论

对各种金融产品的概念都有涉及，入门好书

超出我的能力了。星级仅供参考。

[投资组合管理 下载链接1](#)

书评

[投资组合管理 下载链接1](#)