

投资学



[投资学 下载链接1](#)

著者:弗兰克K.赖利

出版者:机械工业出版社

出版时间:2005-6

装帧:平装(无盘)

isbn:9787111163961

本书涵盖了投资学理论的各个重要领域。主要内容包括五大部分：投资环境、风险管理、权益证券的定价与管理、固定收益证券的分析和监测投资组合。既有各种主要投资工具的讨论，也包括了各种投资方法的分析比较，内容非常丰富。通过本书的学习，读者将具备从事投资理论研究和实际投资工作所必需的基本知识和技能。还可以用做CFA考试参考用书。

作者介绍:

弗兰克 K

.赖利，曾经是圣母大学的工商管理学院的院长，现在在伯纳德J.汉克学院担任工商管理学教授。赖利教授先后获得圣母大学工商管理学学士学位，西北大学工商管理学硕士学位以及芝加哥大学博士学位。刺利教授曾称后任教于伊利诺州立大学、堪萨斯州立大学、怀俄明州立大学和圣母大学。他有数年担任资深证券分析师的经历和从事股票债券交易的经验。他还是一位注册金融分析师，曾在审计委员会、教育和研究委员会、评级委员会任职，目前为注册金融分析师协会托管理事会委员和投资管理与研究协会管理委员会主席。

目录: 译者序

作者简介

前言

第一部分

投资环境

第1章 投资的框架

1.1 什么是投资

1.2 投资中的重要问题

1.3 金融环境

1.4 投资策略

1.5 职业道德和投资中的就业机会

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第2章 收益和风险的基础知识

2.1 收益和风险示例

2.2 收益的类型

2.3 历史收益率的测量

2.4 预期收益率的计算

2.5 风险的定义

2.6 风险的测量

2.7 必要收益率的决定因素

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第3章 在全球市场中选择投资

3.1 全球投资的案例

3.2 全球投资选择

3.3 不同投资的历史风险/收益

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

附录3a 协方差和相关性

第4章 共同基金与其他管理投资

4.1 什么是共同基金

4.2 按投资组合目标分类的共同基金类型

4.3 招募说明书

4.4 共同基金信息的其他来源

4.5 投资公司的绩效

4.6 共同基金的投资策略

4.7 其他管理投资概述

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第5章 资产配置决策

5.1 风险管理

5.2 个人投资者的生命周期

5.3 投资组合的管理过程

5.4 建立投资计划书的要求

5.5 为投资计划书输入信息

5.6 资产配置的重要性

5.7 资产配置与文化差异

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

附录5a 机构投资者的投资目标和限制

第6章 证券市场的组织和运行

6.1 什么是市场

6.2 初级资本市场

6.3 二级金融市场

6.4 地区交易所和场外交易市场

6.5 交易所市场的详细分析

6.6 证券市场的变化

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

附录6a 世界发达市场和发展中市场的特征

第7章 证券市场指标序列

7.1 证券市场指数的作用

7.2 在建立市场指数过程中需要辨明的因素

7.3 股票市场指标序列

7.4 债券市场指标序列

7.5 股票-债券综合指数

7.6 长期内各指数的比较

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习和电子表格练习

参考文献

本章术语

附录7a 外国股票市场指数

第二部分

风险管理

第8章 投资组合管理

8.1 一些背景假设

8.2 马科维茨投资组合理论

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第9章 资产定价模型

9.1 资本市场理论概述

9.2 资本资产定价模型：预期收益率和风险

9.3 套利定价理论

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第10章 有效资本市场

10.1 为什么资本市场应该是有效的

10.2 几种有效市场假设

10.3 有效市场假设的检验和结果

10.4 行为金融学

10.5 有效市场的含义

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

参考文献

本章术语

第11章 衍生工具

11.1 为什么存在衍生工具

11.2 远期合约

11.3 期货合同

11.4 期权

11.5 期权交易策略

11.6 卖出/买入平价

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第12章 衍生工具：分析与定价

12.1 期货定价

12.2 金融期货的高级应用

12.3 期货期权

12.4 买入期权与卖出期权的定价

12.5 布莱克-斯科尔斯期权定价公式

12.6 类似期权的证券

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第三部分

权益证券：定价与管理

第13章 经济与行业分析

13.1 联系行业分析与有效市场

13.2 证券分析的一般方法

13.3 为什么要用三步定价过程

13.4 经济概念概览

13.5 对经济与证券市场的影响

13.6 预测工具

13.7 经济预测的风险

13.8 预期分析

13.9 行业分析

13.10 经济与行业部门的联系

13.11 经济与行业的结构性影响

13.12 行业竞争性结构

13.13 行业生命周期分析

13.14 进行行业分析

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

附录13a 行业信息来源

第14章 财务报表分析

14.1 本章目标

14.2 主要财务报表

14.3 财务比率分析

14.4 财务比率计算

14.5 内部流动性评价

14.6 经营绩效评估

- 14.7 风险分析
- 14.8 增长潜力的分析
- 14.9 比率的比较分析
- 14.10 非美国财务报表的分析
- 14.11 财务报表的质量
- 14.12 财务报表分析的价值
- 14.13 财务比率的具体用途

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第15章 公司分析与股票定价

- 15.1 公司分析与股票的定价及选择

- 15.2 寻找真正的成长型股票

- 15.3 定价理论

- 15.4 几种投资的定价

- 15.5 与公司分析有关的经济、行业和结构性因素

- 15.6 公司分析

- 15.7 威尔格林公司的内在价值估计

- 15.8 用市盈率确定具体价值

- 15.9 制定投资决策

- 15.10 对分析师的影响因素

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

附录15a 公司分析的信息来源

附录15b 恒定增长股息贴现模型的扩展

第16章 技术分析

- 16.1 技术分析的基本假设

- 16.2 技术分析的优点

- 16.3 技术分析面临的挑战

- 16.4 技术交易规则和指标

- 16.5 国外市场的技术分析

- 16.6 债券市场的技术分析

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

参考文献

本章术语

第17章 权益组合管理

- 17.1 消极管理和积极管理

- 17.2 消极权益组合管理策略

- 17.3 积极权益组合管理策略

17.4 权益组合管理中的期货与期权

17.5 应税投资组合

17.6 资产配置策略

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第四部分

固定收益证券：分析与管理

第18章 固定收益分析

18.1 债券定价基本原理

18.2 债券收益率的计算

18.3 未来债券价格的计算

18.4 什么决定了利率

18.5 什么决定了债券价格的波动性

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第19章 固定收益投资组合管理

19.1 可供选择的债券投资组合策略

19.2 在固定收益投资组合管理中使用衍生证券

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

第五部分

监测投资组合

第20章 投资组合管理评估

20.1 综合投资组合绩效测度

20.2 基准投资组合

20.3 基准比较和投资组合风格

20.4 较好（或较差）绩效的决定因素

20.5 债券投资组合的绩效评估

小结

投资在线

简答题

计算题

网上练习

电子表格练习

参考文献

本章术语

附录20a 计算投资组合的收益率
附录a 如何成为特许金融分析师
附录b 投资管理与研究协会：道德准则与职业行为标准
附录c 利率表
附录d 标准正态分布表
• • • • • [\(收起\)](#)

[投资学_下载链接1_](#)

标签

金融

投资

评论

有两封面 我的是绿皮的 字小 数据出错 翻译糟糕
看的极其来气！但是还要坚持(T__T)(另一个封面的出版时间比较新
内容排版不知道有没有改进…)

[投资学_下载链接1_](#)

书评

[投资学_下载链接1_](#)