

投资学原理与应用



[投资学原理与应用_下载链接1](#)

著者:朱顺泉

出版者:清华大学出版社

出版时间:2006-3

装帧:简装本

isbn:9787302125167

本书试图在现代投资理论的基础上，建立实用的资产定价模型，以供有志于从事投资学研究和教学的读者参考。这是一本供财务管理、金融工程、金融学、会计学、统计学、管理科学、应用数学、数量经济学等专业的本科高年级与研究生使用的教材，适当地考虑了它的深度和广度。本书的起点，基本上定位在具有微积分、线性代数、概率统计的

基础上，而有关随机过程、偏微分方程、数值分析等方面的知识，在要用到时会作专门介绍。

本书的显著特点是：以现代投资理论为基础，定量分析方法和统计优化模型为中心，在介绍各种资产定价原理的基础上，利用实际数据给出其应用与实证分析的例子，因而具有一定的理论深度和较高的应用价值。

本书的主要内容包括：(1)现代投资理论的简要描述；(2)投资分析的统计方法；(3)Markowitz的投资组合理论；(4)投资组合优化模型及其应用；(5)资本资产定价模型(CAPM)及其应用；(6)套利定价理论(APT)及其应用；(7)Black—Scholes看涨(看跌)期权定价模型的推导；(8)Black—Scholes期权定价模型的计算程序与应用；(9)二项式期权定价模型及其计算程序与应用；(10)证券投资分析的因子模型及其应用。

本书是一本供金融工程、财务管理、会计学、金融学、统计学、管理科学、应用数学、数量经济学等专业的本科高年级与研究生使用的教材或参考书。

作者介绍:

目录:

[投资学原理与应用 下载链接1](#)

标签

评论

[投资学原理与应用 下载链接1](#)

书评
