

# 资产组合的收益与风险



[资产组合的收益与风险\\_下载链接1](#)

著者:李博

出版者:中国经济出版社

出版时间:2006年08月

装帧:平装

isbn:9787501775163

在理论分析部分，作者全面回顾和总结了资产组合理论的研究成果，在对单一时期的资产组合理论，即静态的资产组合理论，进行系统分析的基础上，对模型的理论基础、前提假设和模型推导进行了深入分析和探讨，并对各种模型进行了综合评价。作者认为，资产组合选择理论主要研究最优资产组合的收益-风险关系，其实质是收益极大化和风险极小化；而资产定价理论则主要研究资本市场处于均衡状态时，资产或资产组合的收益与各种影响因素之间的关系。一方面，作者讨论了马科维兹的均值-方差资产组合选择模型、单指数资产组合选择模型、最优资产组合选择的简化模型，同时根据最优资产组合选择原则和其他风险度量指标，讨论了均值-绝对离差、均值-半方差和均值-风险价值资产组合选择模型；另一方面，作者讨论了资产定价模型，包括多因素资产定价模型和套利定价模型，特别是在四种因素变量的基础上，探讨多因素资产定价模型。

作者介绍:

目录: 前言  
第一章 导论

第一节	资产组合理论的研究对象
第二节	资产组合理论的历史发展和研究现状
第三节	本书的研究目标、结构和主要贡献
第二章	资产组合的选择理论
第一节	马科维兹的资产选择模型
第二节	资产组合选择的简化模型
第三节	资产组合选择的简化模型
第四节	多期资产组合选择模型
第三章	资产定价理论
第一节	资本资产定价模型
第二节	扩展的资本资产定价模型
第三节	多因素资本资产定价模型
第四节	套利定价理论
第五节	跨期资产定价模型
第六节	资产定价模型在国的应用——理论分析
第四章	资产组合选择和资产定价理论的实证研究评析
第一节	资产组合分散风险能力的研究
第二节	资本资产定价模型的实证检验
第三节	套利定价模型的实证检验
第四节	资产定价的多因素解释
第五节	资产组合选择和资产定价理论在的实证检验评析
第五章	资产组合选择和资产定价理论在我国的实证研究
第一节	股票组合的收益和风险分析
第二节	股票组合收益率的影响因素分析——多因素资产定价模型
第三节	基金收益与风险关系的实证研究——基金业绩评价的因素
第四节	资产定价的多因素解释
第五节	资产组合选择和资产定价理论在的实证检验评析
第五章	资产组合选择和资产定价理论在我国的实证研究
第一节	股票组合的收益和风险分析
第二节	股票组合收益效率的影响因素分析——多因素资产定价模型
第三节	基金收益与风险关系的实证研究——基金业绩评价的因素模型
第四节	基金的投资风格研究
	参考文献
	后记
	· · · · · (收起)

[资产组合的收益与风险\\_下载链接1](#)

标签

评论

-----  
[资产组合的收益与风险\\_下载链接1\\_](#)

书评

-----  
[资产组合的收益与风险\\_下载链接1\\_](#)