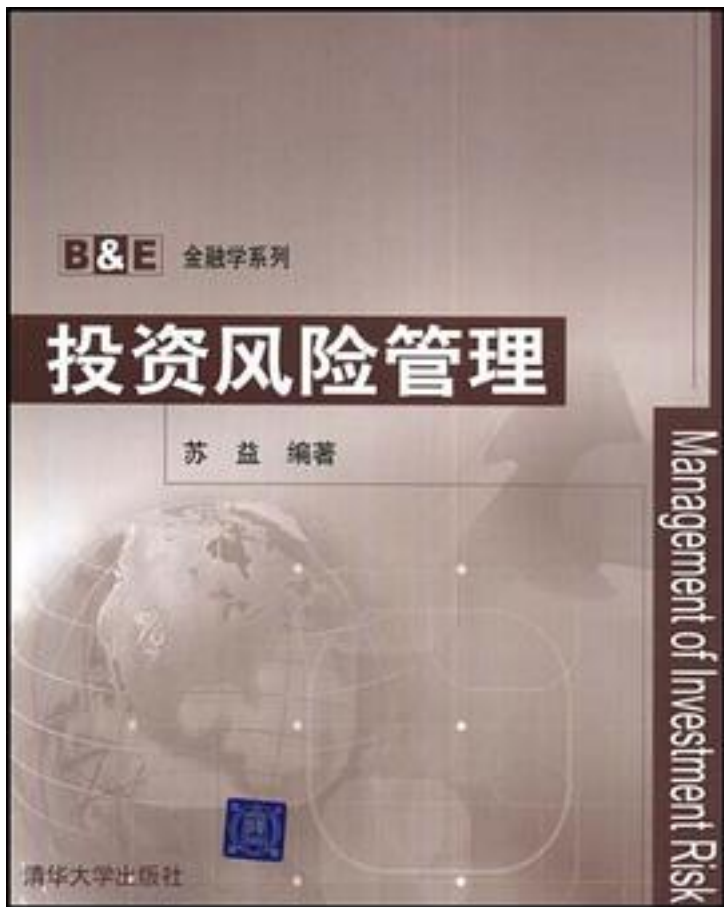


投资风险管理



[投资风险管理_下载链接1](#)

著者:朱平辉

出版者:厦门大学

出版时间:2007-12

装帧:

isbn:9787561528723

《投资决策分析系列教材·投资风险管理》主要内容：在学习投资风险管理之前，读者如果已学习过投资经济学、证券投资学、项目评估等课程，并有一定的数理基础，会给学习《投资决策分析系列教材·投资风险管理》带来一定的方便。但是，即使没有学习过以上课程，只要有足够的耐心，读者也能阅读《投资决策分析系列教材·投资风险管理

》并且大体上掌握《投资决策分析系列教材·投资风险管理》的内容。因为风险管理理论与技术都是人们生活中处置风险事件的总结，一般人都有类似的生活阅历，它并不是高深莫测的抽象道理。熟练掌握风险管理的技术，当然需要相应的数量分析，我们在附录中罗列了直接相关的数学知识，就是为了方便读者随时翻阅。“投资组合保险”主要是机构投资者在投资风险管理中使用的策略，它涉及较为复杂的数学模型，该章我们加了星号，作为选学内容。

作者介绍:

目录: 总序

前言

第一章 总论

第一节 投资风险及其分类

第二节 风险管理思想的演变

第三节 风险管理的新观念

第二章 预期收益与风险

第一节 投资者的风险态度与无差异曲线

第二节 有效边界与最优组合

第三节 预期收益与风险的关系

第三章 传统投资风险管理方法与套期保值

第一节 传统投资风险管理方法概述

第二节 套期保值的原理

第三节 套期保值方法的应用

第四章 VaR技术简介

第一节 VaR法的基本原理

第二节 VaR的估计方法

第三节 VaR的应用

第五章 投资组合的VaR

第一节 投资组合的VaR

第二节 利用EXCEL计算VaR组合与分解

第三节 巴林银行为什么会突然破产?

第六章 债券投资风险与控制

第一节 债券市场、利率和类型

第二节 债券的收益与风险

第三节 债券投资风险的管理与控制

第七章 外汇投资风险与控制

第一节 外汇与外汇市场

第二节 外汇汇率

第三节 外汇抽资收益与风险管理

第八章 股票投资风险及其管理

第一节 股票投资

第二节 股票投资的风险分析

第三节 股票投资管理策略与风险控制

第九章 期货投资风险及其控制

第一节 期货投资基础知识

第二节 期货的定价及风险评估

第三节 期货投资及其风险管理

第四节 股指期货及其在股票市场风险管理中的应用

第十章 投资组合保险的理论及应用

第一节 投资组合保险的基本概念

第二节 投资组合保险策略

第三节 投资组合保险策略的应用

第十二章 项目投资风险的评估

第一节 项目投资及其评价

第二节 投资风险评估

第十三章 项目投资风险的管理与控制

第一节 项目风险管理的基本问题

第二节 投资前时期的风险管理

第三节 投资执行期的风险管理

第四节 生产运行期的风险管理

附录 相关基础知识

第一节 函数的导数

第二节 向量与矩阵

第三节 统计学基础

参考文献

• • • • •

(收起)

[投资风险管理_下载链接1](#)

标签

企业

评论

[投资风险管理_下载链接1](#)

书评

[投资风险管理_下载链接1](#)