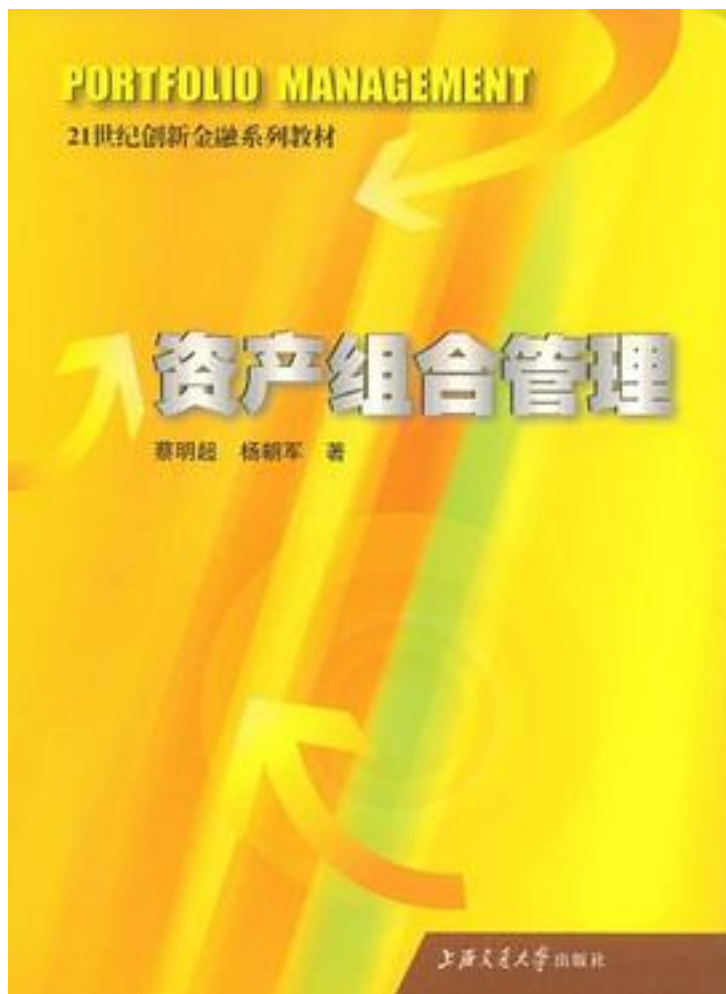


资产组合管理



[资产组合管理_下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2009-1

装帧:

isbn:9787313054494

《资产组合管理》是一本面向投资组合管理流程的投资分析定量教材。第1章简要分析了资产组合管理决策流程中投资哲学的主要内容与选择。第2章与第3章采用定量分析的

方法说明了投资者与市场的互动过程，包括收益与风险偏好，资本市场预期的形成。第4章和第5章分别论述了经典的资产组合管理问题，Goldman Sachs公司拓展地引入了投资者主观预期的最优资产配置模型。第6至8章讨论了市场效率与被动投资的关系、主动投资下的有效边界、在主动投资哲学下如何整合基础分析与技术分析等问题。第9至11章分别讨论了三个专门的问题：资产配置的决策目标、养老金的资产配置及衍生产品组合管理。最后一章是绩效评估理论，回答了投资者能否根据过往的投资绩效来选择基金经理人问题，并介绍了全球投资绩效标准(GIPS)。

《资产组合管理》的设计目标是架起连接学术界与产业界、投资银行研究人员与市场营销人员的桥梁。

作者介绍:

目录:

[资产组合管理_下载链接1](#)

标签

大二下

评论

[资产组合管理_下载链接1](#)

书评

[资产组合管理_下载链接1](#)