

赫特&布洛克投资管理学



[赫特&布洛克投资管理学_下载链接1](#)

著者:杰弗里 A 赫特

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2009-12

装帧:平装

isbn:9787300114514

《赫特&布洛克投资管理学(原书第9版)》的许多章节里我们增加了投资顾问难题。这些难题描述了投资者所面临的问题和困境。我们在教师手册（在教师网站上）里给出了这些问题的解决方案。这些投资顾问难题为教授提供了广阔的机会来讨论职业道德，同时也是CFA协会指定的实践标准。

国外最好的投资管理学教材之一。美国知名金融学教授和畅销书作者联手打造，中国知名投资学教授、中国人民大学财政金融学院刘曼红教授领衔翻译。案例、实例丰富，手把手教你投资管理。

作者介绍:

杰弗里·A·赫特，赫特博士是德宝大学（DePaul University）的金融学教授。他曾获得伊利诺伊州立大学金融学博士学位，迈阿密大学MBA硕士学位，俄亥俄卫斯理大学学士学位。从1987年到2001年，他为芝加哥投资分析师协会指导租赁金融分析研究项目。

从1987年到1997年，他在德宝大学教授投资学和金融管理学，并担任德宝大学金融系主任。赫特博士是美国中西部金融协会的前主席，并担任过《金融教育杂志》的编辑。从2002年到2005年，他任职芝加哥投资分析师团队的理事，并担任《投资咨询》杂志的编辑。从2002年到2005年，他任职芝加哥投资分析团队的理事，并担任《投资咨询》杂志的编辑。

赫特博士在2006年被授予“德宝杰出人才”的荣誉称号。在2007年冬季，他还在意大利的乌尔比诺大学担任客座教授。

目录: 第一部分 投资导论

第1章 投资设定

1.1 投资形式

1.2 投资目标的设定

1.3 风险和报酬的衡量

1.4 预期回报的实际考虑因素

1.5 你将学到什么

附录1A 投资领域的职业机会

第2章 证券市场：现在和未来

2.1 市场环境

2.2 市场功能

2.3 一级市场的构成：投资银行家

2.4 二级市场的构成

2.5 纽约股票交易所的构成

2.6 纳斯达克股票市场

2.7 电子通讯网络

2.8 其他交易所

2.9 场外市场

2.10 机构交易

2.11 证券市场监管

第3章 市场参与

3.1 市场中的买卖行为

3.2 交易指令的类型

3.3 交易成本

3.4 税收和《2003年税法》

3.5 价格表现的衡量方式：市场指数

3.6 指数和平均数

第4章 投资信息的来源

4.1 总体经济数据

4.2 投资顾问机构

4.3 SEC档案、期刊及日志

4.4 数据库

4.5 互联网与投资信息

第二部分 股票分析和估值

第5章 经济活动

5.1 经济活动和经济周期

5.2 经济周期和周期性指标

5.3 股票价格和经济变量

5.4 经济周期和行业间的关系

第6章 行业分析

6.1 行业生命周期

6.2 行业结构

6.3 案例：制药行业

6.4 行业集团与滚动投资

第7章 公司估值

7.1 基本估值概念

7.2 回顾风险与收益的概念

7.3 股利估值模型

7.4 收益估值模型

7.5 市盈率

7.6 其他应用平均价格比率的模型

7.7 预测每股收益

7.8 增长型股票和增长型公司

7.9 从资产价值角度评估股票价值

附录7A 可持续增长模型

第8章 财务报表分析

8.1 主要财务报表

8.2 证券分析员关注的核心比率

8.3 比率应用

8.4 比较长期趋势

8.5 财务报表的缺陷

第三部分 有效市场问题

第9章 技术分析基础

9.1 技术分析

9.2 图表的运用

9.3 一系列重要指标

第10章 有效市场和市场状况异常

10.1 有效市场假说

10.2 弱式有效市场假说

10.3 半强式有效市场假说

10.4 强式有效市场假说

10.5 超常收益

10.6 兼并与收购

10.7 新股发行

10.8 交易所上市

10.9 股票回购

10.10 小公司和低市盈率效应

10.11 账面市值比效应

10.12 其他与股票相关的市场状况异常

10.13 真实的超额回报还是计算错误

第四部分 固定收益证券和杠杆证券

第11章 债券及固定收益证券基础

11.1 债券合约

11.2 担保债券和非担保债券

11.3 债券市场的组成部分

11.4 债券市场投资者

11.5 配售过程

11.6 债券评级

- 11.7 垃圾债券或高收益债券
- 11.8 债券报价
- 11.9 债券市场、资本市场理论及市场有效性
- 11.10 全球债券市场
- 11.11 其他形式的固定收益证券
- 11.12 债务筹资的替代品——优先股
- 第12章 债券估值介绍
- 12.1 债券定价过程的基本原则
- 12.2 收益率
- 12.3 利率波动
- 12.4 投资决策：对利率的考虑
- 12.5 债券互换
- 第13章 久期和投资概念
- 13.1 债券估价的基本概念回顾
- 13.2 久期
- 13.3 久期与价格敏感性
- 13.4 久期影响综合
- 13.5 久期与零息债券
- 13.6 久期的应用
- 13.7 债券再投资假设与终端财富分析
- 附录13A 修正久期和凸性
- 第14章 可转换证券和认股权证
- 14.1 可转换证券
- 14.2 转换价格和转换比例
- 14.3 对发行公司而言的优缺点
- 14.4 可转换证券的财务考虑
- 14.5 认股权证的投机
- 14.6 认股权证的财务考虑
- 第五部分 衍生产品
- 第15章 看跌和看涨期权
- 15.1 期权市场
- 15.2 期权清算公司
- 15.3 基本期权策略
- 15.4 期权组合
- 15.5 期权的其他考虑因素
- 附录15A 布莱克—斯科尔斯期权定价模型
- 附录15B 差价期权和套期图利期权的运用
- 第16章 商品和金融期货
- 16.1 商品和交易所的种类
- 16.2 实际商品合约
- 16.3 学习市场报价
- 16.4 现货市场与期货市场
- 16.5 金融工具的期货市场
- 16.6 货币期货
- 16.7 利率期货
- 16.8 期权与期货
- 16.9 利率互换
- 第17章 股指期货和期权
- 17.1 衍生品的概念
- 17.2 股指期货交易
- 17.3 股指期货的使用
- 17.4 股指期权交易
- 17.5 股指期权的套期保值交易
- 17.6 股指期货期权

第六部分 拓展投资领域

第18章 共同基金

18.1 共同基金的优缺点

18.2 封闭式基金与开放式基金

18.3 投资于开放式基金

18.4 共同基金信息

18.5 共同基金的不同目标以及分散化投资

18.6 招股说明书

18.7 分红及税收

18.8 股东服务

18.9 投资基金，长期计划及资本平均成本法

18.10 基金绩效评估

附录18A 单位式投资信托公司

第19章 国际证券市场

19.1 世界股权市场

19.2 分散化投资收益

19.3 国际市场的潜在收益

19.4 汇率波动和收益率

19.5 国际投资的其他障碍

19.6 参与国际投资的方式

第20章 实物资产投资

20.1 实物资产的优缺点

20.2 房地产投资

20.3 房地产定价

20.4 房地产所有权形式

20.5 黄金和白银

20.6 珍贵宝石

20.7 其他收藏品

附录20A 房地产投资决策的综合分析

第七部分 投资组合管理概论

第21章 投资组合管理和资本市场理论引言

21.1 风险度量

21.2 资产组合效应

21.3 发展有效资产组合

21.4 资本资产定价模型

21.5 单一证券的收益

21.6 资本资产定价模型的假设

附录21A 相关系数

附录21B 最小二乘法回归分析

附录21C 证券市场线的推导

附录21D 套利定价理论

第22章 投资组合经理的风险与收益度量

22.1 研究历史趋势

22.2 设定目标和风险

22.3 风险收益度量

22.4 多元化

22.5 其他资产和股票

22.6 资产配置实例

附录22A 机构投资者的构成

附录A 美元的复利本利和

附录B 美元年金的复利本利和

附录C 美元的现值

附录D 美元年金的现值

词汇表

• • • • • ([收起](#))

[赫特&布洛克投资管理学_下载链接1](#)

标签

金融

投资

经济

大师傅

人大

list学

评论

第9版 对我来说 是扫盲类别的教科书

写的很好。

[赫特&布洛克投资管理学_下载链接1](#)

书评

[赫特&布洛克投资管理学_下载链接1](#)