

《复旦博学  
微观金融学系列：投资学（第三版）》

书籍信息

版次：3

页数：

字数：456000

印刷时间：2013年12月01日

开本：12k

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787309101089

## 内容简介

基于对现代投资学范畴的理解，张宗新编著的《投资学(第3版)》在第三版的内容安排上遵循了第二版的基本框架结构，主要内容包括资产组合理论、资本市场均衡理论、证券估值、基金投资管理与绩效评价等。在《投资学(第3版)》的设计上也以此为纲，逐一进行分析。通过介绍投资学构架，希望能够引领读者对投资学的构架和理论体系产生一个基本认识。

本书的适用对象为普通高等院校经济、金融类高年级本科生、研究生，同时，也可作为相关领域研究者的参考用书。

## 目录

### 第一章 导论

第一节 现代投资学的发展

第二节 投资与投资流程

第三节 本书的结构框架

### 第二章 证券市场与投资工具

第一节 证券市场

第二节 投资工具

### 第三章 资产组合理论

第一节 风险与风险偏好

第二节 均值一方差分析

第三节 最优组合选择

第四节 资产组合边界与有效前沿

### 第四章 资本资产定价模型

第一节 资本市场均衡 第一章 导论 第一节 现代投资学的发展 第二节  
投资与投资流程 第三节 本书的结构框架 第二章 证券市场与投资工具 第一节  
证券市场 第二节 投资工具 第三章 资产组合理论 第一节 风险与风险偏好  
第二节 均值一方差分析 第三节 最优组合选择 第四节  
资产组合边界与有效前沿第四章 资本资产定价模型 第一节 资本市场均衡  
第二节 资本市场线与证券市场线 第三节 证券市场风险结构 第四节  
CAPM的实证检验第五章 因素模型和套利定价理论 第一节 因素模型 第二节  
套利定价理论第六章 有效市场假说和行为金融理论 第一节 有效市场理论  
第二节 证券市场有效性检验 第三节 行为金融理论对有效市场假说的挑战 第七章  
股票市场投资分析 第一节 宏观经济与行业分析 第二节 股票估值模型 第三节  
财务报表分析 第四节 股票投资的配置策略 第八章 债券市场投资分析 第一节  
货币的时间价值 第二节 债券价值分析 第三节 债券收益率曲线 第四节  
债券定价与风险管理第九章 金融衍生市场投资分析 第一节 远期合约分析

第二节 期货合约投资分析 第三节 期权合约投资分析 第四节  
互换合约投资分析第十章 基金投资与绩效评价 第一节 基金投资管理 第二节  
基金投资绩效评估方法 第三节 基金投资业绩的持续性检验 参考文献  
[显示全部信息](#)

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

[更多资源请访问www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)