

图书基本信息

书名：<<运用Excel VBA进行高效投资决策>>

13位ISBN编号：9787113075361

10位ISBN编号：7113075363

出版时间：2006-12

出版时间：中国铁道

作者：韩良智

页数：367

字数：559000

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

本书利用Excel VBA开发了各种金融计算模型，这些模型具有广泛的实用性和通用性，用户只要输入一些最基本的数据，模型就自动进行运算，并输出计算结果和绘制有关图表，从而成为真正意义上的计算模型，以使用户进行高效投资决策。

本书可供金融机构、企事业单位和经济管理部门的广大金融技术人员和财务管理人员阅读，也可作为大专院校金融工程专业和管理类高年级本科生、研究生和MBA学员的教材或参考书。

## 书籍目录

第1章 Excel VBA基础知识 1-1 宏概述 1-2 VBA概述 1-3 VBA编程基础 1-4 窗体控件 1-5 自动宏第2章 单一证券的收益与风险 2-1 单一证券的收益 2-2 单一证券的标准差第3章 投资组合的收益与标准差 3-1 证券间协方差计算模型 3-2 证券间相关系数计算模型 3-3 投资组合收益率和标准差计算模型第4章 投资组合的有效边界 4-1 两个风险资产投资组合的有效边界模型 4-2 多个风险资产投资组合的有效边界模型第5章 最优投资组合 5-1 多个风险型资产的最优投资组合模型 5-2 一个无风险资产与多个风险型资产的最优投资组合模型 5-3 最优投资组合的规划求解模型第6章 投资组合的风险价值 (VaR) 6-1 风险价值概述 6-2 风险价值的基本计算模型 6-3 投资组合风险价值的方差——协方差计算模型 6-4 投资组合风险价值的历史数据模型法计算模型 6-5 投资组合风险价值的蒙特卡罗模拟计算模型第7章 资本市场模型 7-1 单一证券市场线计算及绘制模型 7-2 资本资产定价模型第8章 债券投资分析模型 8-1 债券价值基本计算分析模型 8-2 债券久期计算分析模型 8-3 债券投资计算分析模型 8-4 债券的投资组合管理免疫策略模型第9章 股票估价模型第10章 期权交易策略模型第11章 期权定价的二项式定价模型第12章 期权定价的布莱克 - 舒尔斯模型第13章 投资组合保险第14章 期货套期保值第15章 开发应用模块和应用程序参考文献

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>