

<<Excel在金融模型分析中的应用>>

图书基本信息

书名：<<Excel在金融模型分析中的应用>>

13位ISBN编号：9787115123237

10位ISBN编号：7115123233

出版时间：2004-6-1

出版时间：人民邮电出版社

作者：刘善存

页数：222

字数：349000

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>

## <<Excel在金融模型分析中的应用>>

### 内容概要

本书主要介绍了项目评估金融基本模型、证券投资组合有效前沿理论、资本资产定价理论、期权定价理论、投资组合套期保值策略、债券的久期理论和免疫策略等现代金融模型及其用Excel实现的过程。

本书将抽象的金融模型通过Excel的数据处理和图表形式来解释、验证和求解，强调Excel的实现过程，旨在使读者通过阅读本书，既熟悉当前金融理论的模型、含义和思想，又能够熟练掌握Excel在处理矩阵、统计、规划以及VBA应用等方面的强大功能。

本书可作为证券从业人员以及金融管理和分析人员的参考书，也可作为高等院校经济、金融专业本科生和研究生的教材。

## 书籍目录

第1章 Excel在基本金融模型中的应用 1.1 资金时间价值 1.2 投资项目决策 1.3 股利现金流贴现模型  
1.4 资本成本第2章 投资组合模型引论 2.1 两个风险资产的简单算例 2.2 投资组合期望收益和方差的  
计算 2.3 多个风险资产投资组合的期望收益和方差的计算 2.4 综合实例第3章 方差——协方差矩阵的  
计算 3.1 用超额收益矩阵计算方差——协方差矩阵 3.2 用Visual Basic应用程序编程计算方差——协方  
差矩阵 3.3 用OFFSET函数计算方差——协方差矩阵 3.4 用单指数模型计算方差——协方差矩阵 3.5 综  
合实例第4章 无卖空限制下计算有效前沿 4.1 有效前沿理论和资本资产定价模型 4.2 有效前沿的计算  
4.3 资本市场线和市场组合的计算 4.4 证券市场线及其计算 4.5 综合实例第5章 有卖空限制下计算有  
效前沿 5.1 有卖空限制的投资组合 5.2 VBA方法计算有卖空限制下的有效前沿 5.3 综合实例第6章 期  
权概念引言 6.1 期权基本概念和术语 6.2 简单投资策略的收入函数和利润曲线 6.3 股票期权和股票组  
合策略的利润函数 6.4 看涨期权与看跌期权平价关系 6.5 综合实例第7章 二项式期权定价模型的计算  
7.1 单阶段的二项式期权定价问题 7.2 多阶段二项式期权定价模型的计算 7.3 运用二项式期权模型定  
价美式期权 7.4 综合实例第8章 Black-Scholes期权定价模型的计算 8.1 Black-Scholes期权定价公式 8.2  
运用VBA定义Black-Scholes期权定价函数 8.3 股票收益率的波动率的计算 8.4 运用VBA函数计算隐含波  
动率 8.5 综合实例第9章 投资组合套期保值策略 9.1 利用看跌期权实现投资组合的套期保值 9.2 利用  
投资组合复制策略进行套期保值 9.3 应用指数期货进行套期保值 9.4 综合实例第10章 债券久期 10.1  
债券久期的计算 10.2 修正久期的计算 10.3 不均匀支付债券的久期的计算 10.4 久期的特征与性质 10.5  
综合实例第11章 债券的免疫策略 11.1 简单免疫策略模型 11.2 债券的凸性和动态免疫策略的计算  
11.3 综合实例附录 Excel常用函数汇总 附录1 财务函数 附录2 数学与三角函数 附录3 统计函数 附录4  
查找与引用 附录5 逻辑函数 附录6 时间与日期函数 附录7 VBA函数

<<Excel在金融模型分析中的应用>>

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>