

<<基于SAS系统的金融计算>>

图书基本信息

书名：<<基于SAS系统的金融计算>>

13位ISBN编号：9787302081654

10位ISBN编号：7302081654

出版时间：2004-5

出版时间：清华大学出版社

作者：朱世武

页数：342

字数：508000

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>

<<基于SAS系统的金融计算>>

内容概要

本书每章对应一个金融方面的专题，内容相互独立。

各章内容一般由三大模块组成：金融理论和模型、算法实现以及计算程序。

所有章节的内容都展现了一个研究项目的相关计算，既有金融理论又有在中国金融市场的实际应用背景。

本书以解决金融研究和世纪问题为出发点，给出的许多算法和实现程序具有很高的应用和参考价值；每章的计算程序精心设计，思路清晰，许多语句都加上了注释，为阅读和理解本书内容提供了可靠的保证。

本书为读者的学习和工作提供了大量的可供参考程序，并可以作为有关SAS编程技术和金融的计算的工具使用。

本书适合多层次多专业的人士阅读，如金融、经济、数学和统计学等专业的本科生、研究生及有关部门的专业人员。

<<基于SAS系统的金融计算>>

作者简介

朱世武，数量经济专业博士、金融工程专业博士后。

清华大学经济管理学院国际贸易与金融系副教授，中国金融学会金融工程专业委员会委员，清华大学中国金融研究中心金融数据中心负责人。

主要研究兴趣为固定收益、风险管理、金融统计、金融计算与数据挖掘。

讲授过的课程有金融数据库、金融统计学、实证金融学、数据模型与决策以及统计分析软件等。

现主持国家自然科学基金、社科基金及211工程项目各1项。

国内外学术期刊发表论文30余篇。

著有《SAS编程技术与金融数据处理》。

<<基于SAS系统的金融计算>>

书籍目录

第1章 本书金融数据介绍 1.1 金融计算数据 1.2 个股数据 1.3 复权个股数据 习题第2章 股票市场收益计算 2.1 收益定义与加总 2.2 单个股票收益计算 2.3 多股票收益计算 2.4 投资组合收益计算 习题第3章 固定收入证券计算 3.1 收益计算 3.2 其他计算 习题第4章 股本与市值比例计算 4.1 股本比例计算 4.2 市值比例计算 4.3 个股平均市值及换手率计算 习题第5章 收益波动率计算第6章 股票指数编制与计算第7章 股权风险溢价计算第8章 股票市场风险指标计算第9章 股市风险指标分解算法第10章 存款数据整理与分析第11章 中国股市CAPM计算第12章 中国股市CAPM验证第13章 随机模拟基本技术第14章 VaR计算与事后检验第15章 利率期限结构计算第16章 可转换债券定价计算第17章 右截尾数据EM算法

<<基于SAS系统的金融计算>>

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>