

<<实验金融学>>

图书基本信息

书名：<<实验金融学>>

13位ISBN编号：9787509507094

10位ISBN编号：750950709X

出版时间：2008-2

出版时间：中国财政经济出版社

作者：周爱民等著

页数：491

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>

<<实验金融学>>

内容概要

《实验金融学》为“南开大学经济类系列实验教材”中的一本。全书共分十七章，主要介绍了股票定价模型，债券收益率计算与债券定价，债券的波动性度量，利率期限结构与收益率曲线，与保证金信用交易有关的计算，期权的BS定价及其参数关系的讨论，二重期权组合的利损分析，四重期权组合的利损分析，期权现货套利组合的利损分析，权证定价，掉期与金融期货的定价，蒙特卡罗模拟等内容。

《实验金融学》内容新颖，重点突出，详略得当，能理论联系实际，深入浅出，通俗易懂。

书籍目录

第一章 Excel基础与投资项目评价第一节 Excel的函数与公式第二节 Excel的数据与图表第三节 终值、现值与净现值第四节 基于内部收益率法的投资决策分析第五节 利用金融工程改善投资决策的分析第六节 房屋按揭现金流的实际计算第二章 股票定价模型第一节 股利现值定价模型第二节 BDC股票定价模型第三节 伯恩哈德股票定价模型 (Bernhard Model) 第四节 WKA股票定价模型第五节 股票定价的逐步回归法第三章 债券收益率计算与债券定价第一节 债券收益率的计算第二节 零息债券与附息债券的定价第三节 浮动利率债券与反向浮动利率债券定价第四章 债券的波动性度量第一节 久期及其计算第二节 债券的久期分析第三节 凸性的计算第四节 波动性度量的指标和相关SAS函数第五章 利率期限结构与收益率曲线第一节 零息票债券收益率推算息票债券收益率第二节 Matlab实现利率期限结构的计算第三节 多项式回归模型第四节 多项式回归模型的具体示例第六章 与保证金信用交易有关的计算第一节 背景知识第二节 保证金买空交易第三节 保证金卖空交易第七章 期权的BS定价及其参数关系的讨论第一节 期权的BS定价第二节 期权的利损曲线第三节 期权的无盈亏点计算第四节 期权的BS定价及其利损值与行使价格之间的关系第五节 期权的BS定价及其利损值与其他参数之间的关系第八章 二重期权组合的利损分析第一节 分跨与宽跨期权组合第二节 垂直进出差价期权组合第三节 水平进出差价期权组合第四节 对角进出差价期权组合第九章 三重期权组合的利损分析第一节 三重期权组合的背景知识第二节 基于Excel的叠做差价期权组合分析第三节 基于Excel的逆叠做差价期权组合分析第四节 基于VB的叠做差价期权组合分析第五节 基于VB的逆叠做差价期权组合分析第十章 四重期权组合的利损分析第一节 背景知识第二节 基于Excel的三明治期权组合分析第三节 基于Excel的蝶形期权组合分析第四节 基于VB的三明治期权组合分析第五节 基于VB的蝶形期权组合分析第十一章 期权现货套利组合的利损分析第一节 上、下限期权现货套利组合的利损分析第二节 单、双限期期权现货套利组合的利损分析第三节 回廊、逆回廊期权现货套利组合的利损计算第十二章 二叉树风险证券定价法第一节 状态价格定价技术第二节 二叉树方法为欧式期权定价第三节 二叉树方法为美式期权定价第四节 二叉树方法为债券定价 (SAS) 第五节 C++实现二叉树定价第十三章 权证定价第一节 背景知识第二节 权证的定价模型第三节 权证定价的具体示例第四节 二叉树模型为权证定价第五节 修正的BS公式为权证定价第十四章 掉期与金融期货的定价第一节 掉期的定价第二节 外汇期货的定价与避险第三节 国债期货的定价与避险第四节 股指期货的定价与避险第十五章 EMH动态检验与单位根检验第一节 基于Excel的动态随机游走模型第二节 基于EVIEWWS的动态随机游走模型第三节 单位根检验第四节 协整分析第十六章 蒙特卡罗模拟第一节 年金保险中的蒙特卡罗模拟第二节 基于Matlab的期权定价蒙特卡罗模拟第三节 基于Mathematica的期权定价蒙特卡罗模拟第四节 基于EVIEWWS的蒙特卡罗模拟第十七章 几种奇异期权的定价第一节 背景知识第二节 回顾期权及其定价第三节 彩虹期权及其定价第四节 基于Excel的复合期权定价第五节 基于VB、Matlab和VC的复合期权定价

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>