

<<投资学原理及其计算机方法>>

图书基本信息

书名：<<投资学原理及其计算机方法>>

13位ISBN编号：9787302179085

10位ISBN编号：7302179085

出版时间：2008-9

出版时间：清华大学出版社

作者：王兴德

页数：392

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>

## <<投资学原理及其计算机方法>>

### 内容概要

《投资学原理及其计算机方法（配光盘）》是一本与其他投资学教材与教学参考书不同的投资学著作，是第一本在计算机技术平台上系统地讲授投资学原理的、具有开创性的书籍。书中一方面利用在计算机上生成的各种图形与可调图形帮助阐明投资学理论的各种数学原理；另一方面又通过大量例子详细讲解在计算机上应用基于Excel的XD建模法，并根据这些数学原理来解决各种理论与实际问题的具体操作方法，这些计算机操作方法既可帮助读者加深对抽象的投资学数学理论的理解，又填补了投资学数学原理与实际应用之间的沟壑。因此，《投资学原理及其计算机方法（配光盘）》是一本具有鲜明的信息时代特色、21世纪投资学必读的书。

《投资学原理及其计算机方法（配光盘）》所附光盘包含了为书中讲解的大量例子所建立的Excel计算模型与相关的各种图形与可调图形，读者可以通过参考其中提供的宝贵资料更好地理解与掌握书中讲解的、应用计算机解决投资学问题的知识与技能。

## <<投资学原理及其计算机方法>>

### 作者简介

王兴德，男，1937年4月出生，江苏扬州人。  
中国科学院理学硕士，加拿大约克大学工商管理硕士。  
上海财经大学教授。

兼任中国系统工程学会系统动力学专业委员会常务委员、全国高等学校教育技术协作委员会学术委员、中国管理科学研究院学术委员会研究员、著名管理咨询公司AMT公司专家顾问。

自1995年开始从事管理决策的计算机方法的研究，其研究成果反映在《财经管理计算机应用》（主编，上海财经大学出版社）、《现代管理决策的计算机方法》（中国财政经济出版社）、《管理决策模型55例》（上海交通大学出版社）与《财经管理中的信息处理》（上海远东出版社）、《电子化决策分析》（清华大学出版社）等著作与多篇论文中，提出了一种基于Excel的、科学的建模分析方法（即XD建模法）与一种基于Excel的、多维数据分类汇总分析方法（即D函数分析法）。

2003年应天津财经大学的邀请，到该校从事财经专业课程教学内容信息化的研究与推广工作。

## &lt;&lt;投资学原理及其计算机方法&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 债券投资1.1 债券发行价格的确定1.2 债券价值随时间的变化1.3 债券的到期收益率及其价格-收益率曲线1.4 债券的久期1.5 债券组合的久期1.6 债券组合免疫技术第2章 利率的期限结构2.1 债券的收益率曲线2.2 即期利率与远期利率2.3 用预期动态演变计算未来即期利率的预测值2.4 贴现因子2.5 短期利率2.6 动态现值计算方法第3章 远期合约与期货合约3.1 远期合约与期货合约的基本概念3.2 利用期货（或远期）合约对冲策略来降低或消除风险3.2.1 对冲资产与风险源资产是同一资产时的期货对冲策略3.2.2 对冲资产与风险源资产是不同资产时的期货对冲策略3.2.3 对于非线性风险的对冲3.3 资产远期价格（与期货价格）的计算3.4 远期汇率与利率平价关系3.5 远期合约的价值第4章 组合投资的均值—方差理论4.1 随机变量及其线性组合的期望值、方差与协方差4.2 资产的总回报与回报率4.3 风险资产期望回报率、方差与协方差估计值的计算4.4 组合资产的期望回报率与方差4.5 资产的分散化4.6 由两个资产组成的组合曲线4.7 由三个以上资产组成的投资机会集合与最小方差曲线4.8 马柯维茨模型及其Solver求解方法4.9 根据马柯维茨模型导出的最小方差曲线的双曲线方程4.10 在三个基础资产情况下平面与平面之间的映射4.11 最小方差曲线的第一重要性质（两基金定理）4.12 最小方差曲线的第二重要性质4.13 在组合资产中包含一个无风险资产时的资本配置线第5章 投资者的最优资本配置5.1 只有两个风险资产可供选择5.2 有多个风险资产可供选择5.3 有一个无风险资产与一个风险资产可供选择5.4 有一个无风险资产与两个风险资产可供选择5.5 有一个无风险资产与多个风险资产可供选择第6章 资本资产定价模型6.1 市场均衡6.2 资本市场线6.3 资本资产定价模型6.4 任一资产的系统性风险与非系统性风险6.5 证券市场线第7章 期权及期权策略7.1 股票看涨期权与看跌期权买卖双方的收益特征7.2 期权策略7.2.1 保护性看跌期权7.2.2 补抛的看涨期权7.2.3 跨式期权7.2.4 差价期权7.2.5 双限期权7.3 看跌-看涨期权平价定理第8章 股票期权价值的确定参考文献代跋

## <<投资学原理及其计算机方法>>

### 章节摘录

第1章 债券投资 土地、房屋以及工厂中的各种机器设备均是人们熟知的实物资产，它们具体地代表了社会财富。

现代社会中还有一种与这些实物资产不同的资产，那就是金融资产，例如股票与债券等。

股票与债券都是一种纸质的票据，这些票据赋予它们的持有者对于公司的（利用实物资产创造出来的）利润或政府收入的某种要求权，因而可以为他们在未来的一定期间内周期性（或一次性）地带来现金流量形式的财富。

实物资产可以用来创造收入，而金融资产则表示了对于这些收入的占有权。

金融资产也称为金融工具，它们可以在人群之间进行交易。

具有完善交易市场、因而可以自由与方便地进行交易的那些金融工具称为证券。

正像在实物市场上进行交易的商品具有不同的价格一样，在金融市场上进行交易的各种证券也具有不同的价格，每种证券的当前价格一方面取决于它所表示的在未来不同时刻发生的一串现金流量的数额，同时也取决于当前的利率。

债券是一种常见的证券，其发行者既可以是政府也可以是各种公司。

政府为筹集资金而发行的债券中最有代表性的是国库券，一些大公司为了筹集资金也经常发行各种债券。

债券实际上是发行者向投资者借入资金的一种“借据”，投资者以购入债券的形式向债券发行者借出资金，并且按照债券（“借据”）上注明的票面价值（面值）在到期时获得发行者归还的一笔本金，此外，大多数债券还在到期前按照发行时规定的规则，每隔一定周期向其持有者支付一笔称为“息票金额”的固定金额利息。

息票金额支付的周期可能是1年或更短的期间（换言之，息票金额的每年支付次数可以等于1也可以大于1），按照惯例，美国债券的息票金额支付周期通常为半年（即每年支付两次）。

## <<投资学原理及其计算机方法>>

### 编辑推荐

《投资学原理及其计算机方法（配光盘）》所附光盘包含了为书中所有例子建立的计算模型及相关的各种图形与可调图形，以供读者学习时参考。

**理论与实践紧密结合** 《投资学原理及其计算机方法（配光盘）》利用在计算机上制作的各种可调图形解释投资学原理，帮助读者在计算机环境中跨越理解这些原理与应用这些原理来解决实际问题二者之间的鸿沟，从而帮助读者掌握在计算机上思考与解决各种投资学问题的能力与养成这样的习惯。

**独创性强** 作者充分利用计算机与XD建模法的强大功能讲解了一些其他投资学教材没有说明过的问题，或者对国外著名教材的叙述作了改进，因此在一定意义上充实了投资学的理论原理。

**实例丰富** 《投资学原理及其计算机方法（配光盘）》提供了大量在计算机环境中应用XD建模法解决各种投资学问题的实例，并且在书附光盘中提供了供读者借鉴的、解决这些问题的计算模型与求出的解答。

<<投资学原理及其计算机方法>>

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>