

<<金融市场计算技术>>

图书基本信息

书名：<<金融市场计算技术>>

13位ISBN编号：9787542916938

10位ISBN编号：7542916939

出版时间：2006-8

出版时间：立信会计出版社

作者：王忠郴赵迎东

页数：289

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>

## <<金融市场计算技术>>

### 内容概要

本书力求做到循序渐进、结构严谨，让学生在掌握许多常用的金融市场计算技术与方法过程中，了解一些金融市场实务中经典的基本数学原理和金融数学模型。

本书力求既有理论研究更有大量具体案例剖析和例题讲解，以做到理论与实际的紧密结合。

书中的内容涵盖了金融市场基本概念、货币时间价值、金融预测、金融决策、资产组合、金融期货、金融期权与金融工程等众多方面的问题分析，并收集了作者在模糊金融数学方面的部分研究成果，为学员今后有关专业实务课程学习及踏上工作岗位的实务操作打下扎实的定量分析能力基础。

## &lt;&lt;金融市场计算技术&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 金融市场基础概论 第一章 金融市场基本概念 第一节 金融市场五要素 第二节 金融市场的结构 第二章 几个具体的金融市场简介 第一节 票据市场 第二节 拆借市场 第三节 证券市场 第二篇 金融市场计算技术方法 第三章 货币的时间价值 第一节 单利与复利公式 第二节 贴现及资金还原公式 第四章 金融预测方法 第一节 相关因素推算法 第二节 趋势预测法 第三节 回归预测法 第四节 马尔可夫预测法 第五章 金融决策方法 第一节 确定型决策 第二节 随机型决策 第三节 不确定型决策 第四节 投资决策评价方法 第三篇 金融市场风险管理 第六章 收益与风险 第一节 单期与多期收益率 第二节 风险偏好与效用函数 第七章 金融风险度量与评估模型 第一节 风险直接度量方法 第二节 金融风险评估模型 第八章 风险识别预警与监测量化方法 第一节 贷款风险的模糊识别模型 第二节 金融风险预警与监测量化方法 第九章 金融工程中风险管理技术 第一节 金融工具与金融风险 第二节 市场风险管理中VaR方法 第三节 几种常用金融衍生工具损益分析简介 第四篇 现代资产组合理论 第十章 资产组合模型 (MPT) 第一节 资产组合理论中几个重要概念 第二节 马科维茨模型及其评价 第三节 一种选择较优资产组合的模糊集方法 第四节 证券组合模型输入数据变动的实证分析 第十一章 资本资产定价模型 (CAPM) 第一节 CAPM模型 第二节 CAPM模型应用 第三节 CAPM模型扩展 第四节 CAPM模型检验 第十二章 多因子模型: 套利定价理论 (APT) 第一节 APT模型 第二节 APT模型与CAPM模型的关系 第三节 模型参数的估计与检验 第五篇 金融衍生工具 第十三章 金融期货 第一节 金融期货概念及其类型 第二节 金融期货的套期保值 第三节 基差与金融期货的价格构成 第四节 金融期货中的风险管理 第十四章 金融期权 第一节 金融期权概念及其类型 第二节 布莱克-斯科尔斯期权估价模型 第三节 二叉树定价模型 第四节 金融期权中的风险管理 第十五章 衍生工具潜在风险区间估计 第一节 衍生工具潜在风险成因分析 第二节 风险区参考文献

## <<金融市场计算技术>>

### 编辑推荐

《金融市场计算技术》是以金融市场业务为主线，以计算技术与数量化方法为分析工具，为提高高等院校经济管理类专业学生对金融业务的实际计算能力而编写的。

《金融市场计算技术》紧密联系金融市场业务实际，强调理论的应用性是其显著的特色。

全书分金融市场概论篇、金融市场计算技术基本方法篇、金融市场风险管理篇、现代资产组合理论篇和金融衍生工具篇等五篇十五章。

内容主要包括：金融市场五要素、货币的时间价值、金融预测法、金融决策方法、金融工程中风险管理技术、资产组合模型、资本资产定价模型、套利定价理论、金融期货与金融期权等。

<<金融市场计算技术>>

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>