第一图书网, tushu007.com

<<Matlab与金融模型分析>>

图书基本信息

书名：<<Matlab与金融模型分析>>

13位ISBN编号：9787810937023

10位ISBN编号：7810937022

出版时间：2007-12

出版时间：合肥工业大学

作者：邓留保,李柏年,杨桂元

页数：300

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

内容概要

《Matlab与金融模型分析》主要介绍了：经济金融学中的资金的时间价值模型，包括现值与终值、年金、固定资产的折旧与摊销、按揭贷款的分期付款、投资项目评估等；债券、股票的价值评估模型；债券的久期和凸性理论及其免疫策略；证券组合投资有效前沿理论、资本资产定价模型、证券投资技术分析；期权及其交易策略、期权定价理论；套期保值策略等现代金融模型和理论及其Matlab实现过程。

《Matlab与金融模型分析》每章对应一个经济金融方面的专题，各章内容相互独立，理论与实际相结合。

既包含了相关的金融理论、模型和思想，又能利用Matlab金融工具箱、金融衍生工具箱、固定收益工具箱、金融时间序列工具箱等工具箱中的内嵌函数，再结合适当编程，将抽象的金融模型通过Matlab的数据处理和图形形式来加以解释、验证和求解，旨在使读者通过阅读《Matlab与金融模型分析》，既熟悉当前的金融理论、模型和思想，又能够熟练使用Matlab软件来处理经济金融中的定量计算与分析问题。

作者简介

李柏年，(1913-)，辽宁开原人，1933年9月南京中央军校第十期，后任国民革命军整编第一师第一旅旅长。
安徽财经大学统计与应用数学学院副院长李柏年李柏年，1982年元月毕业于合肥工业大学，现任安徽财经大学统计与应用数学学院副院长、教授、硕士生导师、九三学社蚌埠市委委员、市政协常委.李柏年先后在《高校应用数学学报》、《数学季刊》、《数理统计与应用概率》、《工程数学报》、《系统工程理论与实践》、《运筹与管理》、《模糊系统与数学》等国家级核心期刊发表论文二十多篇，其中2篇被EI检索。
杨桂元，男，1957年5月出生，安徽萧县人。
1982年元月毕业于安徽大学应用数学专业，获理学学士学位。
现为安徽财经大学统计与应用数学学院党总支书记兼数量经济研究所所长；教授，硕士生导师，享受安徽省人民政府特殊津贴。
研究方向：数量经济学、金融工程。
在《数量经济技术经济研究》、《统计研究》、《系统工程理论与实践》、《中国管理科学》、《运筹与管理》、《预测》、《统计与信息论坛》等刊物发表学术论文70余篇，出版专著1部，主编教材4部，其中《线性代数》获安徽财经大学2004年优秀教材一等奖。
曾获得四川省科技进步一等奖；安徽省教育厅人文社会科学优秀成果三等奖；安徽省教育厅教学成果三等奖。
2001年被教育部授予“ 全国优秀教师 ”称号；2003年被安徽省教育厅授予“ 教学名师 ”。

书籍目录

第一章 金融数据处理的Matlab基础1.1 Matlab入门1.2 数、向量及矩阵的运算1.3 日期的处理与转换1.4 货币的格式与转换1.5 金融数据图形绘制第二章 资金的时间价值2.1 单利与复利2.2 现值与净现值2.3 终值及其应用2.4 年金及其应用2.5 折旧与摊销2.6 有效年利率与连续复利2.7 投资项目决策分析第三章 债券的价值评估3.1 债券相关的基本概念3.2 贴现债券的价值评估3.3 到期一次还本付息债券的价值评估3.4 附息债券的价值评估第四章 债券的收益计算4.1 计算债券的应计利息4.2 计算债券的各种收益率第五章 债券的风险度量与管理5.1 债券的久期5.2 债券的凸性5.3 债券的风险管理第六章 股票的价值评估6.1 股利贴现模型6.2 不变增长模型中参数的确定6.3 资本成本第七章 投资组合理论7.1 单一证券的收益和风险7.2 证券组合的收益和风险7.3 证券组合的可行域7.4 建立线性约束条件矩阵7.5 证券组合的有效边界7.6 确定最优证券组合7.7 积极收益与跟踪误差有效边界第八章 证券投资主要技术指标分析8.1 技术指标概述8.2 平滑异同移动平均线（MACD）8.3 威廉指标（wMS）8.4 相对强弱指标（RSI）8.5 能量潮指标（OBV）8.6 K线图第九章 期权及其交易策略9.1 期权的基本概念和术语9.2 期权的交易策略9.3 看涨期权与看跌期权的平价关系第十章 二项式期权定价10.1 单期二项式期权定价10.2 多期二项式期权定价第十一章 Black—Scholes期权定价模型11.1 Black—Scholes期权定价模型11.2 期权价格和内在价值随时间变化的比较分析11.3 股票收益率的波动率计算11.4 Black—Scholes期权价格的敏感性分析第十二章 套期保值策略12.1 套期保值的基本原理12.2 利用期权进行套期保值第十三章 金融时间序列分析13.1 金融时间序列数据集的创建与运用13.2 金融时间序列用户图形界面功能简介参考文献

编辑推荐

第一图书网, tushu007.com

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