第一图书网, tushu007.com

<<MATLAB金融工程与资产管理>>

图书基本信息

书名：<<MATLAB金融工程与资产管理>>

13位ISBN编号：9787811244410

10位ISBN编号：7811244411

出版时间：2008-11

出版时间：张树德 北京航空航天大学出版社 (2008-11出版)

作者：张树德

页数：243

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

前言

金融创新是金融业未来发展的重要方向。
金融工程学的出现使金融业走入产品设计时代，其个性化的产品对投资者而言无疑是有吸引力的。
这一切都需要金融工程软件的支持。
MATLAB在金融资产定价和风险管理方面有着强大的功能，是国际主流的金融工程软件，特别是MATALB的金融工具箱更是得到金融界的广泛好评。
金融工具箱是一个函数库，每个函数就是一个金融问题的解决方案，把这些函数组装起来就变成一个程序，把程序集结起来就变成一个系统。
MATLAB金融工具箱使金融从业人员摆脱繁琐的编程工作，直接深入金融问题的本质，及时发现问题，并找出解决方案，提高金融研究及解决实际问题的效率。
MATI。
AB语法简单，易学易懂，即使没有编程背景，经过短期自学也可以很快上手，是大学生、研究生以及金融研究人员的有力工具。
很多没有编程背景的研究人员，也能利用MATLAB做出非常有价值的研究成果。
本书介绍如何运用MATLAB解决金融问题，也是作者这几年金融学习的心得。
书中不足之处恳请读者批评指正。
作者2008年4月1日于上海

内容概要

本书介绍了金融工程的基本原理及应用方法，特色在于使用MATLAB金融工具箱对金融工程模型进行计算，通过详细的实例演示MATLAB解决金融问题的具体过程。
读者能够很快掌握金融工程的主要内容与方法。

本书的内容涉及金融工程基本应用，并且辅有大量的实例，内容十分丰富，读者只需具备初步数学基础知识与金融知识即可顺利阅读本书大部分内容。

本书可作为高等院校金融专业的教材和教学参考书，亦可供金融研究人员和金融机构从业人员参考。

书籍目录

第1章 金融市场与金融工具1.1 金融市场的概念及功能1.1.1 金融市场的概念1.1.2 金融市场的作用1.1.3 金融市场的功能1.2 金融市场的类型．1.2.1 货币市场1.2.2 债券市场1.2.3 股票市场1.2.4 外汇市场1.2.5 保险市场1.2.6 金融衍生品市场1.3 金融市场主体本章小结第2章 固定收益证券2.1 固定收益基本知识2.1.1 固定收益品种2.1.2 固定收益相关概念2.2 应计天数计算2.2.1 应计天数计算方法2.2.2 计算票息支付次数2.2.3 计算前一个票息支付日2.2.4 计算下一个票息支付日2.2.5 计算票息日期2.2.6 全价和净价2.2.7 应计天数因子2.2.8 应计利息2.2.9 贴现率计算2.2.10 计算内部收益率2.3 现金流现值与终值2.3.1 现金流现值2.3.2 现金流终值2.3.4 计算赎回价格本章小结第3章 久期与凸度3.1 久期3.1.1 久期的概念3.1.2 久期的计算公式3 2 凸度3.2.1 凸度的概念3.2.2 凸度计算公式3 3 久期匹配管理3.3.1 久期匹配管理概念3.3.2 久期匹配计算本章小结第4章 利率期限结构4.1 即期利率和远期利率4.1.1 即期利率4.1.2 远期利率4.2 利率期限结构4.2.1 利率期限结构概念4.2.2 利率期限结构理论4.2.3 利率期限结构计算4.2.4 利率曲线转换为贴觋率曲线4.2.5 零息曲线为固定收益产晶定价4.2.6 零息曲线计算敏感性参数4.3 远期利率协议4.3.1 远期利率协议概念4.3.2 FRA与利率期货的区别4.3.3 FRA风险4.3.4 FRA的价格与报价4.3.5 计算远期利率4.3.6 利率期限结构转换为利率远期本章小结第5章 可转换债券5.1 可转换债券的基本知识5.1.1 可转换债券的概念51.2 可转换债券的基本要素5.1.3 可转换债券的嵌入期权5.1.4 发行可转换债券的优点5.2 可转换债券的计算本章小结第6章 互换第7章 回购第8章 可转让定期存单第9章 资产组合计算第10章 VaR方法第11章 期权定价第12章 期权的二叉树定价第13章 MATLAB和其他软件数据连接第14章 金融数据的可视化附录A MATLAB基础附录B 命令表附录C MATLAB网上资源参考文献

章节摘录

1.1.1 金融市场的概念金融市场是市场经济体系的一个重要组成部分，它与消费品市场、生产资料市场、劳动力市场、技术市场、信息市场、房地产市场和旅游服务市场等各类市场相互联系。
在现代经济中，无论是消费资料、生产资料的买卖，还是技术和劳动力的流动等，各种市场的交易活动都要通过货币的转手和资金的运动来实现。
从这个意义上说，金融市场的发展对整个市场体系的发展起着举足轻重的作用。
1.1.2 金融市场的作用金融是现代经济的核心。
经济的发展依赖于资源的合理配置，而资源的合理配置主要靠市场机制的运作来实现。
金融体系核心功能是促进资源在不确定的情况下进行跨市场、跨时间的配置。
金融市场的发展有利于提高社会资金使用效率。
开放金融市场能有效地从社会吸收游资和闲散资金，根据资金的紧缺情况．在各部门、各地区之间重新分配资金。
另外，在资本市场上．资金在利益最大化的驱使下自由流动，因而必然流向经济效益高的部门。
资金在市场上的融通，有利于发挥资金的规模效益，而且资金融通能及时满足商品生产和商品流通变化的需要，有效地促进全社会生产要素的合理配置。

编辑推荐

《MATLAB金融工程与资产管理》可作为高等院校金融专业的教材和教学参考书，亦可供金融研究人员和金融机构从业人员参考。

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