第一图书网, tushu007.com

<<Excel在投资理财中的应用>>

图书基本信息

书名：<<Excel在投资理财中的应用>>

13位ISBN编号：9787121014499

10位ISBN编号：7121014491

出版时间：2005-7

出版时间：电子工业出版社

作者：韩良智

页数：422

字数：571000

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

本书结合大量的实例，系统翔实地介绍了Excel 2003在投资理财活动中的实际应用，在系统地介绍投资理财的基本理论和基本方法的同时，详细介绍了运用Excel 2003解决各种投资理财问题的方法，包括建立各种预测、决策、计算和分析模型等。
全书共分11章。
第1章详细介绍了Excel 2003的基本知识，第2章至第11章分别介绍Excel 2003在各类投资理财活动中的实际应用，包括资金的时间价值计算、储蓄与贷款、投资项目评价、债券投资、股票投资、投资组合决策、证券投资分析、期权的基本原理、期权定价和期权应用。
本书注重实用性和可操作性，适合企事业单位和经济管理部门从事投资理财活动的管理人员，以及普通的个人投资者阅读，也可以作为大专院校经济管理类专业高年级本科生、研究生和MBA学员相关课程的教材和参考书。

书籍目录

1 中文版Excel 2003基础知识 31.1 中文版Excel 2003的新增功能 31.1.1 列表 31.1.2 改进的统计函数 51.1.3 XML支持 61.1.4 智能文档 71.1.5 共享工作区 71.1.6 信息权限管理 71.1.7 并排比较工作簿 81.1.8 信息检索 91.2 中文版Excel 2003的启动与退出 91.2.1 启动中文版Excel 2003 91.2.2 退出中文版Excel 2003 101.3 中文版Excel 2003的工作界面 101.3.1 标题栏 101.3.2 菜单栏 111.3.3 工具栏 121.3.4 工作表 121.3.5 任务窗格 131.4 录入数据 141.4.1 单元格及单元格区域的选取 141.4.2 输入数据 151.4.3 编辑数据 201.5 工作表编辑和格式化 241.5.1 调整单元格 241.5.2 插入行、列和单元格 271.5.3 删除行、列和单元格 291.5.4 隐藏与冻结行、列、单元格和工作表 291.5.5 使用多个工作表 321.5.6 设置工作表格式 361.6 运用公式 381.6.1 公式的运算符及其优先级 381.6.2 输入公式 401.6.3 引用单元格 401.6.4 编辑公式 411.6.5 使用数组公式 421.6.6 显示或隐藏公式 431.6.7 几种特殊情况下的计算公式 441.6.8 使用名称 441.6.9 公式返回的错误信息 451.7 使用函数 461.7.1 函数的基本语法 461.7.2 调用函数 471.7.3 嵌套函数 491.7.4 使用Excel的帮助能理解函数 491.7.5 常用函数介绍 511.8 创建图表 591.8.1 图表类型 591.8.2 图表的建立 591.8.3 图表的编辑与格式化 611.8.4 组合图表的绘制 641.9 数据管理 661.9.1 创建和使用数据清单 661.9.2 数据筛选 681.9.3 数据排序 721.9.4 数据分类汇总 741.10 数据透视表和数据透视图 751.10.1 创建及使用数据透视表和数据透视图 761.10.2 更新数据透视表 791.10.3 编辑数据透视表 801.10.4 删除数据透视表 801.11 数据分析工具 801.11.1 单变量求解 801.11.2 规划求解 811.11.3 统计分析工具 841.12 打印工作表 841.12.1 工作表的打印设置 851.12.2 打印预览 891.12.3 打印输出 901.13 Web应用 911.13.1 浏览Web页 921.13.2 打开最近访问的Web页 921.13.3 进行Web查询和获取数据 922 资金的时间价值 992.1 终值和现值 992.1.1 一笔款项的终值和现值 992.1.2 年金的终值和现值 1072.1.3 不等额现金流的终值和现值 1122.2 利率的计算 1152.2.1 名义利率、实际利率及现值和终值的计算 1152.2.2 已知现值和终值求利率 1182.2.3 年金对应利率的计算 1192.2.4 等差序列现金流对应利率的计算 1202.2.5 等比序列现金流对应利率的计算 1212.2.6 不规则现金流对应利率的计算 1212.3 期限的计算 1222.3.1 已知终值和现值求期限 1232.3.2 年金对应期限的计算 1232.3.3 等差序列现金流对应期限的计算 1242.3.4 等比序列现金流对应期限的计算 1252.3.5 不规则现金流对应期限的计算 1252.4 等值年金的计算 1262.4.1 等值普通年金和等值先付年金的计算 1272.4.2 等值延期年金的计算 1282.4.3 已知不规则现金流求等值年金 1293 储蓄与贷款分析 1313.1 存款利息的计算 1313.1.1 我国关于存款利息计算的有关规定 1313.1.2 活期储蓄 1323.1.3 整存整取储蓄 1333.1.4 定活两便储蓄 1353.1.5 零存整取储蓄 1363.1.6 整存零取储蓄 1373.1.7 存本取息储蓄 1383.1.8 到期自动转存是否合算 1393.1.9 定期存款期限内遇到利率上调时是否应提前支取 1403.2 贷款的偿还方式 1423.2.1 等额利息法 1423.2.2 等额摊还法 1433.2.3 等额本金法 1463.2.4 一次性偿付法 1473.2.5 四种还贷方法比较 1483.3 房贷款偿还方式的比较 1493.3.1 住房贷款的还款方式 1493.3.2 住房贷款还款方式的比较 1533.4 提前还贷 1563.4.1 全部提前还贷 1563.4.2 部分提前还贷 1573.5 住房贷款计算器 1593.5.1 住房贷款计算器的设方法 1593.5.2 住房贷款计算器的应用实例 1623.6 个人住房按揭贷款利率及万元偿还本息金额表 1623.6.1 个人住房公积金按揭贷款利率及万元偿还本息金额表 1633.6.2 个人住房商业按揭贷款利率及万元偿还本息金额表 1643.7 住房贷款月还款额与贷款利率和期限的关系 1643.8 利用网上工具进行存贷款的计算 1654 投资项目评价 1694.1 折旧与现金流量预测 1694.1.1 折旧的概念及其计算方法 1694.1.2 现金流量预测 1734.2 投资项目的评价指标 1754.2.1 净现值 1754.2.2 获利能力指数 1774.2.3 内部收益率 1784.2.4 值 1794.2.5 静态投资回收期 1804.2.6 动态投资回收期 1804.2.7 平均报酬率 1814.3 独立项目的投资决策 1814.4 互斥项目的投资决策 1844.4.1 投资规模不同的互斥项目决策 1844.4.2 寿命期限不同的互斥项目决策——更新链法 1854.4.3 寿命期限不同的互斥项目决策——净年值法 1864.4.4 寿命期限不同的互斥项目决策——等值年成本法 1874.5 多方案投资组合决策与规划求解 1884.5.1 多方案投资组合决策问题的基本数学模型 1884.5.2 多方案投资组合决策问题的规划求解 1884.6 投资项目的敏感性分析 1904.6.1 根据因素变动的上下限进行敏感性分析 1914.6.2 根据因素变动率进行敏感性分析 1924.7 盈亏平衡分析 1944.7.1 静态盈亏平衡分析 1944.7.2 动态盈亏平衡分析 1965 债券投资 1995.1 债券的价值 1995.1.1 价值的计算 1995.1.2 债券价值与市场利率的关系 2035.1.3 债券价值与期限的关系 2045.1.4 债券价值与还本付息方式的关系 2055.1.5 债券价值动态分析模型 2065.2 债券的投资收益率 2085.2.1 到期收益率 2085.2.2 赎回收益率 2115.2.3 预计到期收益率 2125.2.4 已实现的复利收益率 2135.2.5 持有期收益

率 2145.3 债券投资的利息 2155.3.1 定期付息债券的利息 2155.3.2 到期付息债券的利息 2165.3.3 零息债的隐含利息 2165.4 债券的久期 2175.4.1 债券久期的计算 2175.4.2 债券久期的影响因素分析 2215.4.3 根债券久期预测债券价格的变化 2235.5 债券投资组合管理的免疫策略 2266 股票投资 2296.1 股票价值评估 2296.1.1 定期持有股票的估价 2296.1.2 零增长股的估价 2306.1.3 固定增长股的估价 2316.1.4 多重增长股的估价 2326.1.5 市盈率比率模型 2336.2 股票投资收益 2356.2.1 股票投资收益率的计算公式 2356.2.2 票投资收益率的计算实例 2376.2.3 考虑交易费用情况下的股票投资收益率的计算 2386.3 股票投资的风险 2406.3.1 标准差和变差系数 2406.3.2 系数 2436.4 风险与收益之间的关系 2516.4.1 资本资产定价模型 2516.4.2 套利定价模型 2547 投资组合决策 2577.1 投资组合的收益和风险 2577.1.1 根据概率分布计算投资组合的期望收益率与标准差 2577.1.2 根据样本容量计算投资组合的期望收益率与标准差 2607.2 仅有风险资产时的投资组合决策 2627.2.1 两种风险资产的最优投资组合 2627.2.2 多种风险资产的最优投资组合 2677.2.3 多种风险资产投资组合的动态计算与分析模型 2717.3 无风险资产与风险资产的投资组合决策 2757.3.1 无风险资产与一种风险资产的投资组合 2757.3.2 无风险资产与两种风险资产的投资组合 2787.3.3 无风险资产与多种风险资产的最优投资组合 2817.3.4 无风险资产与多种风险型资产投资组合的动态计算与分析模型 2837.4 利用规划求解工具解决最优投资组合问题 2847.4.1 直接求解最低风险下的投资组合 2857.4.2 限定最低期望收益率时风险最低的最优投资组合 2867.4.3 限定最高风险时期望收益率最高的最优投资组合 2887.4.4 利用规划求解工具与直接利用公式求解最优投资组合问题的比较 2897.5 风险价值（VaR）的计算 2917.5.1 风险价值的基本概念 2917.5.2 投资组合的风险价值计算——协方差矩阵法 2937.5.3 投资组合的风险价值计算——历史数据模拟法 2958 证券投资分析 2998.1 财务报表分析 2998.1.1 上市公司的主要财务报表 2998.1.2 财务报表分析的主要方法 3018.1.3 财务报表的结构分析 3028.1.4 财务报表的趋势分析 3058.1.5 财务报表的比率分析 3088.1.6 杜邦分析系统 3158.2 绘制股票价格图形 3168.2.1 绘制K线图 3168.2.2 美化K线图 3198.2.3 绘制移动平均线 3218.3 获取上市公司资料 32 期权的基本原理 3259.1 期权的概念与种类 3259.1.1 期权的基本概念 3259.1.2 期权的种类 3269.2 股票期权到期日的价值与损益 3269.2.1 股票期权到期日的价值 3269.2.2 股票期权到期日的损益 3279.3 股票期权交易的组合策略 3299.3.1 看涨期权与无风险资产的组合 3299.3.2 看跌期权与无风险资产的组合 3319.3.3 购买股票与出售看涨期权的组合 3329.3.4 购买股票与购买看跌期权的组合 3339.3.5 跨式组合 3359.3.6 多份看涨期权与看跌期权的组合 3369.3.7 宽跨式组合 3389.3.8 看涨差价组合 3399.3.9 看跌差价组合 3419.3.1 看涨蝶式组合 3429.3.11 看跌蝶式组合 3449.3.12 鹰式组合 3459.3.13 反鹰式组合 34710 期权定价 3511 二项式期权定价模型 35110.1.1 单期定价模型 35110.1.2 两期定价模型 35410.1.3 多期定价模型 35710.2 布莱克—舒尔斯期权定价模型 36110.2.1 基本的布莱克—舒尔斯期权定价模型 36110.2.2 考虑股利的布莱克—舒尔斯期权定价模型 36310.2.3 布莱克—舒尔斯期权定价动态分析模型 36710.2.4 布莱克—舒尔斯期权定价的敏感性分析模型 36910.2.5 布莱克—舒尔斯期权定价模型的六变量系统 37110.2.6 波动率的估计 37310.3 期权价格的蒙特卡罗模拟 37510.4 投资组合保险 37710.4.1 存在与股票对应的看跌期权时的投资组合保险 37710.4.2 不存在与股票对应的看跌期权时的投资组合保险——动态投资组合策略 37911 期权应用 38311.1 债券的期权定价 38311.1.1 可转换债券的期权定价 38311.1.2 可赎回债券的期权定价 38611.1.3 可退还债券的期权定价 38811.2 认股权证的期权定价 38911.3 期权与股票价值估计 39111.3 仅有股票和零息债券情况下的股票价值估计 39111.3.2 公司价值不确定情况下普通股价值的估计 39211.3.3 多种债券并存情况下普通股价值的估计 39311.3.4 自由现金流与期权方法结合对股票价值进行估计 39511.3.5 处于财务困境公司的股票价值评估 39711.4 专利价值的期权评估 39811.4.1 利用期权对专利价值进行评估需要注意的问题 39811.4.2 对专利技术进行估价 39911.4.3 对仅拥有专利权的公司进行估价 39911.5 实物期权与项目投资决策 40011.5.1 实物期权的分类 40111.5.2 投资决策实例——推迟投资期权 40211.5.3 投资决策实例——扩张投资期权 403附录A Excel工作表函数 404附录B Excel常用键盘快捷键 414参考文献 422

媒体关注与评论

本书特色：　　·图文并茂，深入浅出地介绍了投资理财的基本理论和基本方法。
　　·结合大量实例轻松解决——资金的时间价值计算、储蓄与贷款分析、投资项目评价、债券投资、股票投资、投资组合决策、证券投资分析、期权的基本原理、期权定价及期权应用等难题。

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