

《基于 SAS 系统的金融计算》目录

第 1 章 本书金融数据介绍

1.1 金融计算数据

1.1.1 创建 SAS 逻辑库 COMPUFIN

1.1.2 SAS 数据集

1.1.3 其它数据集

1.1.4 宏文本

1.2 个股数据

1.2.1 创建 SAS 逻辑库 STOINDIV

1.2.2 SAS 数据集

1.3 复权个股数据

1.3.1 创建 SAS 逻辑库 STOINDIF

1.3.2 SAS 数据集

本章参考文献

习题

第 2 章 股票市场收益计算

2.1 收益定义与加总

2.1.1 收益定义

2.1.2 收益加总

2.2 单个股票收益计算

2.3 多股票收益计算

2.4 投资组合收益计算

本章参考文献

习题

第 3 章 固定收入证券计算

3.1 收益计算

3.2 其它计算

本章参考文献

习题

第 4 章 股本与市值比例计算

4.1 股本比例计算

4.2 市值比例计算

4.3 个股平均市值及换手率计算

本章参考文献

习题

第 5 章 收益波动率计算

5.1 波动率估计法

5.2 波动率计算

5.3 等权重组合收益波动率

本章参考文献

习题

第 6 章 股票指数编制与计算

6.1 国内外股票指数编制方法

6.2 指数计算方法论

6.3 指数计算公式

6.4 指数计算程序

本章参考文献

习题

第 7 章 股权风险溢价计算

7.1 股权风险溢价研究方法

7.2 指数风险溢价计算思路

7.3 计算程序

本章参考文献

习题

第 8 章 股票市场风险指标计算

8.1 计算指标与环境

8.2 计算程序与输出结果

本章参考文献

习题

第 9 章 股市风险指标分解算法

9.1 协方差阵引出特征值

9.2 相关计算程序

9.3 计算结果与分析

本章参考文献

习题

第 10 章 存款数据整理与分析

10.1 课题背景

10.2 数据整理与展现

10.3 数据特征探索与分析

10.4 结论与问题

本章参考文献

习题

第 11 章 中国股市 CAPM 计算

11.1 资本资产定价模型 (CAPM)

11.2 数据准备与收益作图

11.3 单支股票的 CAPM 拟合与检验

11.4 多支股票应用 CAPM

11.5 使用 CAPM 回归预测股票超额收益

11.6 使用 CAPM 的 β 和证券市场线买卖股票

本章参考文献

习题

第 12 章 中国股市 CAPM 验证

12.1 理论基础

12.2 计算步骤

12.3 计算程序

12.4 检验结果与分析

本章参考文献

习题

第 13 章 随机模拟基本技术

13.1 分布的模拟实现

13.2 收益模型模拟

13.3 应用案例

本章参考文献

习题

第 14 章 VaR 计算与事后检验

14.1 VaR 概念及度量方法比较

14.2 VaR 度量方法的实现步骤

14.3 VaR 的事后检验

14.4 计算程序

本章参考文献

习题

第 15 章 利率期限结构计算

15.1 利率期限结构拟合模型

15.2 计算程序与结果

本章参考文献

习题

第 16 章 可转换债券定价计算

16.1 可转换债券

16.2 茂炼转债定价案例

16.3 计算程序

本章参考文献

习题

第 17 章 右截尾数据 EM 算法

17.1 EM 算法理论

17.2 右截尾数据简单线性回归计算

本章参考文献

习题