

مشخصات برنامه‌ها و فایل‌های داده MATLAB مورد استفاده در کتاب

ردیف	عنوان	نوع	نام فایل
۱	محاسبه موجودی بانک به روش گسسته	تابع	BankAccount1
۲	محاسبه موجودی بانک به روش پیوسته	تابع	BankAccount2
۳	بازدهی و انحراف معیار با افق‌های زمانی مختلف	اسکرپت	MeanAndStd
۴	حرکت براونی به عنوان حد پیوسته گام تصادفی	اسکرپت	RandomWalkLimit
۵	ایجاد حرکت براونی با استفاده از خواص آن	تابع	BMSim
۶	ایجاد حرکت براونی هندسی	تابع	GBMSim
۷	شبیه‌سازی حرکت براونی هندسی با مقادیر مختلف پارامتر رانش و نوسانات	اسکرپت	MuSigmaGBM
۸	محاسبه ارزش در معرض خطر به روش پارامتریک با فرض توزیع نرمال	تابع	ParVar
۹	محاسبه ارزش در معرض خطر به روش تاریخی	تابع	HistVar
۱۰	مقایسه توزیع بازدهی واقعی با توزیع نرمال	اسکرپت	CompareDist
۱۱	ارزش در معرض خطر به روش شبیه‌سازی مونت کارلو براساس حرکت براونی هندسی	تابع	MCSimVar
۱۲	محاسبه ارزش در معرض خطر شرطی	تابع	CVaR
۱۳	شبیه‌سازی مدل گارچ غیرخطی	تابع	NGARCHSim
۱۴	شبیه‌سازی مدل هستون	تابع	HestonSim
۱۵	شبیه‌سازی حرکت براونی هندسی با جمله جهش (مدل مرتون)	تابع	JGBMSim
۱۶	بهینه‌سازی پرتفوی	تابع	Portfolioopt
۱۷	ترسیم خط بازار سرمایه (SML)	اسکرپت	SML
۱۸	محاسبه معیارهای ارزیابی عملکرد پرتفوی	تابع	PA
۱۹	قیمت‌گذاری ورقه قرضه به روش اول	تابع	bondvalue1
۲۰	قیمت‌گذاری ورقه قرضه به روش دوم	تابع	bondvalue2
۲۱	محاسبه نرخ بازدهی تا سررسید یک ورقه قرضه	تابع	YTM
۲۲	دیرش مک‌آلی با فرض وجود نرخ تنزیل	تابع	Dur
۲۳	تحدب با فرض در دست بودن نرخ تنزیل	تابع	Conv
۲۴	محاسبه نرخ آتی بر اساس نرخ نقدی	تابع	Forwardrate
۲۵	ورقه قرضه با نرخ غیرثابت قطعی به روش اول	تابع	bondvalue3
۲۶	قیمت ورقه قرضه با نرخ غیرثابت قطعی به روش دوم	تابع	bondvalue4
۲۷	محاسبه قیمت دیرش تعدیل شده با نرخ غیرثابت قطعی در فضای گسسته	تابع	Dur2
۲۸	تحدب با نرخ غیرثابت قطعی در فضای گسسته	تابع	Conv2
۲۹	شبیه‌سازی مدل تصادفی واسیچک	تابع	Vsimulation
۳۰	قیمت‌گذاری اوراق اختیار خرید و فروش اروپایی با استفاده از مدل دو جمله‌ای	تابع	BinomEOptPrice

ردیف	عنوان	نوع	نام فایل
۳۱	قیمت‌گذاری اوراق اختیار خرید و فروش امریکایی با استفاده از مدل دو جمله‌ای	تابع	BinomAOptPrice
۳۲	قیمت‌گذاری اوراق اختیار خرید اروپایی با استفاده از رابطه نهایی مدل دو جمله‌ای	تابع	BinomECPrice
۳۳	قیمت‌گذاری اوراق اختیار خرید و فروش اروپایی با استفاده از رابطه بلک و شولز	تابع	BSOptPrice
۳۴	بررسی اثر قیمت‌دارایی پایه و زمان تا سررسید بر قیمت اختیار معامله	اسکرپیت	SandTEffectonOption
۳۵	محاسبه گریکز	تابع	OptGreeks
۳۶	بررسی اثر قیمت‌دارایی پایه و زمان تا سررسید بر گاما و دلتا	تابع	SandTEffectonGammaandDelta
۳۷	محاسبه نوسانات ضمنی اختیار خرید اروپایی با استفاده از الگوریتم نیوتون-رافسون	تابع	EOptIV
۳۸	محاسبه قیمت اختیار خرید امریکایی با استفاده از تقریب بلک	تابع	BlackApprox
۳۹	محاسبه قیمت اوراق اختیار معامله آسیایی با استفاده از شبیه‌سازی مونت‌کارلو	تابع	acpbymesim
۴۰	محاسبه قیمت اوراق آتی	تابع	FPrice
۴۱	محاسبه قیمت قرارداد تاخت نرخ بهره عادی	تابع	SwapPrice
۴۲	محاسبه بازدهی تا سررسید، نرخ بازدهی مؤثر سالانه و نرخ بازدهی درصدی سالانه	تابع	ZCR
۴۳	محاسبه بازدهی تا سررسید، نرخ بازدهی مؤثر سالانه و نرخ بازدهی درصدی سالانه برای زمان‌های مختلف	اسکرپیت	ZCRt
۴۴	مقادیر روزانه شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران	فایل داده	DailyTotalIndex
۴۵	مقادیر ماهانه شاخص ۱۰ صنعت و شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران	فایل داده	MonthlyIndices
۴۶	مقادیر ماهانه متغیرهای مدل سه عاملی فاما و فرنچ	فایل داده	FF