

目錄

第一篇 財務工程基礎導論

CHAPTER 1	財務工程概述	
	1.1 財務工程的起源與意義	5
	1.2 財務工程之步驟	6
	1.3 財務工程快速發展之原因	7
	1.4 金融創新	9
	1.5 風險管理	10
	本章習題	20
CHAPTER 2	風險與報酬	
	2.1 報酬率之概念與衡量方式	25
	2.2 投資績效之衡量方法	26
	2.3 風險的意義與衡量	28
	2.4 風險值 (Value at Risk, VaR)	34
	2.5 考量風險後的投資選擇	35
	本章習題	37
CHAPTER 3	波動率	
	3.1 基本概念	43
	3.2 波動率微笑曲線 (Volatility Smile)	49
	3.3 實務探討	54
	本章習題	65

第二篇 財務工程之市場應用

CHAPTER 4 財務工程之使用工具

4.1 二元樹模型	75
4.2 有限差分法	89
4.3 蒙地卡羅模擬法	103
本章習題.....	110

CHAPTER 5 衍生性金融商品評價模型

5.1 衍生性商品評價模型	117
5.2 股票選擇權評價	124
5.3 債券評價	130
本章習題.....	136

CHAPTER 6 衍生性金融商品的涉險值

6.1 涉險值理論	143
6.2 兩項資產的涉險值.....	148
6.3 投資組合的涉險值.....	151
6.4 涉險值的對角線模型	153
6.5 期貨部位的涉險值.....	158
6.6 選擇權的涉險值	160
本章習題.....	164

(本章附試算表，請讀者自行於http://weblinesfi.org.tw/download/lib_ftp/books/02-437-101.zip下載)

第三篇 財務工程與衍生性金融商品

CHAPTER 7

期貨與選擇權

7.1 期貨與選擇權市場.....	171
7.2 期貨交易.....	177
7.3 選擇權交易.....	183
7.4 實務探討.....	189
本章習題.....	192

CHAPTER 8

權證市場與商品

8.1 全球權證市場.....	197
8.2 權證商品種類、可連結之標的及特性.....	201
8.3 牛熊證及其操作策略.....	206
本章習題.....	211

CHAPTER 9

結構型商品

9.1 結構型商品基礎理論.....	215
9.2 結構型商品之功能.....	219
9.3 結構型商品之風險.....	220
9.4 結構型商品評價.....	222
9.5 實務探討.....	226
本章習題.....	233

CHAPTER 10

利率衍生性商品

10.1 即期利率與遠期利率.....	237
---------------------	-----

10.2	遠期利率協議	240
10.3	到期收益率.....	243
10.4	利率交換	248
10.5	利率上限與下限.....	253
10.6	利率交換選擇權.....	263
	本章習題	266

(本章附試算表，請讀者自行於http://weblinesfi.org.tw/download/lib_ftp/books/02-437-101.zip下載)

CHAPTER 11

可轉換公司債與資產交換

11.1	可轉換公司債市場	271
11.2	可轉換公司債發行條件與評價	274
11.3	可轉換公司債交易與套利.....	277
11.4	可轉換公司債資產交換	278
11.5	實務探討	280
	本章習題	282

CHAPTER 12

信用衍生性商品

12.1	信用風險與違約機率	287
12.2	違約機率與違約的事件模擬.....	291
12.3	信用違約交換	295
12.4	使用模擬法計算CDS價格.....	299
12.5	其他的信用衍生性商品.....	303
	本章習題	306

(本章附試算表，請讀者自行於http://weblinesfi.org.tw/download/lib_ftp/books/02-437-101.zip下載)

參考文獻.....	307
-----------	-----