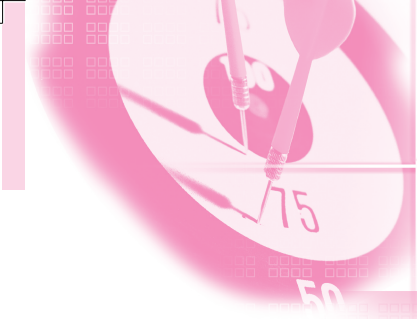




目錄

第一篇 期貨市場導論

CHAPTER 1	期貨市場功能與架構	
1.1	期貨及期貨市場概述	5
1.2	期貨市場的功能	9
1.3	商品期貨與金融期貨	10
CHAPTER 2	期貨市場沿革與概況	
2.1	臺灣期貨市場沿革與發展概況	23
2.2	臺灣期貨服務事業發展概況	27
2.3	全球期貨市場發展概況	31
2.4	全球期貨市場未來發展趨勢	33
CHAPTER 3	期貨交易制度與委託	
3.1	期貨交易流程	45
3.2	期貨交易帳戶種類	54
3.3	期貨委託單種類	60
3.4	期貨市場監理	68
CHAPTER 4	期貨結算制度與保證金	
4.1	期貨市場結算制度沿革	73
4.2	期貨交割結算作業流程	83
4.3	整戶風險保證金計收方式 (SPAN) 簡介	91
4.4	整戶風險保證金計收方式 (SPAN) 範例	95

第二篇 期貨交易實務

CHAPTER 5 期貨交易理論

5.1 期貨定價理論.....	111
5.2 期貨避險.....	127
5.3 期貨價差交易.....	142

CHAPTER 6 股價指數期貨交易與避險實務

6.1 股價指數期貨之投資交易.....	153
6.2 股價指數期貨的功能及運用.....	160
6.3 指數期貨避險交易.....	165
6.4 指數期貨的價差交易策略.....	171
6.5 指數期貨之套利交易與限制.....	175

CHAPTER 7 個股期貨交易實務

7.1 全球個股期貨介紹.....	189
7.2 國內個股期貨現況與發展.....	195
7.3 個股期貨交易策略.....	206
7.4 強化既有基礎及放眼未來發展.....	212

CHAPTER 8 差價合約交易實務

8.1 CFD簡介.....	221
8.2 差價合約交易機制與經紀商.....	224
8.3 CFD評價.....	227
8.4 CFD交易策略探討.....	231
8.5 CFD各國現況與未來的發展.....	233

CHAPTER 9 IT在期貨市場的關鍵運用

- 9.1 臺灣期貨市場在IT的演進243
- 9.2 臺灣期貨公司對IT服務提供的演進.....246
- 9.3 期貨與IT結合的運用實務249
- 9.4 風險控制與IT發展的兼容並蓄269

CHAPTER 10 期貨信託基金 (CTA)

- 10.1 期貨信託基金的沿革275
- 10.2 全球CTA交易策略283
- 10.3 臺灣CTA現況288
- 10.4 臺灣CTA之未來發展.....290

第三篇 選擇權交易實務

CHAPTER 11 選擇權簡介

- 11.1 選擇權之基本性質303
- 11.2 選擇權價值的上下限.....310
- 11.3 裸部位與平價關係312

CHAPTER 12 股價及衍生性商品價格變動模型

- 12.1 馬可夫隨機過程.....323
- 12.2 幾何布朗運動323
- 12.3 伊藤定理326
- 12.4 衍生性商品定價.....328

CHAPTER 13	選擇權評價模型	
13.1	選擇權定價模式.....	341
13.2	歐式與美式選擇權.....	346
13.3	外匯、商品與期貨選擇權.....	348
13.4	股利效應與個股選擇權近似解.....	351
13.5	二項式選擇權定價模式.....	353
13.6	蒙地卡羅模擬.....	361
13.7	有限差分法.....	363
CHAPTER 14	風險參數及選擇權交易策略	
14.1	價差交易策略.....	371
14.2	混合部位.....	378
14.3	選擇權的風險參數.....	382
14.4	選擇權的應用及其避險.....	390

第四篇 期貨市場監理

CHAPTER 15	期貨市場監理架構	
15.1	我國期貨市場概況.....	407
15.2	期貨交易法重要規範.....	415
15.3	期貨市場常見非法案例.....	425
CHAPTER 16	期貨交易所及期貨結算機構管理	
16.1	期貨交易所.....	435
16.2	期貨結算機構.....	438

CHAPTER 17 期貨商管理

17.1 期貨商設置	449
17.2 期貨商財務、業務之管理	452

CHAPTER 18 期貨服務事業管理

18.1 期貨顧問事業	471
18.2 期貨經理事業	475
18.3 期貨交易輔助人	483
18.4 期貨信託事業管理	485
索 引	501
參考文獻	504