

首頁 > 專業、教科書 > 保險、財政、審計學

全站商品

- ▶ 暢銷書&限時活動
- 出版社專區
- 文學小說
- 生活風格
- 國內外旅遊
- 親子教養、童書、青少年英文
- 藝術設計
- 輕小說、漫畫
- 人文、社科、科普
- 商業財經
- 醫療保健
- 宗教、命理、星座
- 電腦資訊
- ▶ 升學、檢定用書
- 語言學習、字典
- 檢定考試用書
- 政府考用書
- 國中、國小參考用書
- 專業、教科書
- 高中、高職參考用書
- 插大研究所、四技二專
- ▶ 風格文具、禮品



本商品適用活動

- 折價券** 首次下載APP送 NT\$50 折價券
- 贈品** 【墊員日】全館消費滿699送5...
- 活動** 會員日消費滿899享20%點數...
- 活動** 【現折\$50】6月全館消費滿11...

金融創新與商品個案

超取滿NT\$450免運



NT\$699

NT\$656

已售完

付款與運送

超取滿NT\$450免運

商品特色

商品編號

5769568

銷售重點

作者: 陳威光

出版社: 新陸書局

出版日期: 2019/07/26

ISBN: 9789869745284

f 分享

中文 (繁體) ▾

商品分類 ▾ 最新活動 ▾ ◆新書預購 ◆暢銷排行 ◆折扣活動 ◆鋼筆刻字

請輸入關鍵字



文具用品

書寫用筆/修正系列

3M用品

黏貼用品

辦公用品

檔案收納

桌曆、筆記本、紙製品

美術、書法用品

貼紙、紙膠帶、花邊帶

禮品、手作

▶ 日用品

襪子

食、飲品

◆會員優惠 詳細說明 商品規格 相關推薦



內容簡介

過去二、三十年來，全球金融市場的創新商品不斷地推陳出新，國內在這一方面也有不錯的進展，許多新的金融商品也陸續出現，譬如槓桿型與反向型 ETF、牛熊證、雙元貨幣投資組合、指數投資證券ETN等等。筆者在教授選擇權等衍生性商品時，也常常喜歡舉這些實際案例來加深學生的印象。學生從這些實際商品案例中，可以了解到產品的推出背景、產品的損益分析、產品的好處及風險、產品的拆解及評價等等。希望藉此可以讓學生們能將艱深的理論與實務互相結合，才不會覺得選擇權等衍生性商

本網站中使用 cookie，欲查詢有關本網站使用 cookie 方式之詳情，及若您不希望電腦上使用 cookie 時應如何變更電腦的 cookie 設定，請參閱本網站「[隱私權條款](#)」之 Cookie 聲明。您繼續使用本網站即表示您同意本公司得按本網站使用條款之 Cookie 聲... [了解更多 >](#)

我知道了

本書包括四個部分，選擇權的基礎、選擇權的進階、金融風險管理以及金融創新商品

- 個人用品 ✓
- 居家清潔與用品 ✓
- 居家·餐廚用品/收納/雨具/拖鞋 ✓
- 旅行收納、露營與運動用品/袖套 ✓
- 包包/皮夾/卡夾 ✓
- ▶ 美妝保養
- 流行彩妝、彩妝刷具、香水 ✓
- 臉部保養 ✓
- 美容工具小物 ✓
- ▶ 3C用品、生活家電
- 生活家電 ✓
- 隨身碟、記憶卡、外接式硬碟、... ✓
- 耳機、數位週邊 ✓
- 鍵盤、滑鼠及電腦周邊 ✓
- 手機線材、手機各類周邊 ✓
- ▶ 日韓貨推薦專區 ✓

個案。本書第 20 章討論了 10 個金融創新商品實務案例，包括指數投資證券 ETN、股票連結票券 ELN、波動度指數 VIX ETF、歐式觸及出場遠期外匯合約 DKO、掩護性買權策略收益成長基金、信用連動債券個案 CLN、股價指數連動債券等等。另外本書在每章後面的實務專欄，也盡量採用市場常見的一些創新商品，讓讀者能多接處一些實務案例。這些實務案例包括目標可贖回遠期契約 TRF、槓桿型與反向型 ETF、牛熊證、正反向利率連動公司債、雙元貨幣外幣投資組合、保本投資型外幣存款、保本型共同基金、可轉換公司債、無本金交割遠期外匯 NDF、巨災債券等等。

鑒於金融創新之理論與實務日新月異，以筆者平庸之質、疏懶之性、力有未逮、謬誤可期，尚希先進不吝賜教，容再版時更正。

作者簡介

陳威光

現職

■ 政治大學金融學系 教授

經歷

- 彰化銀行行員
- 電腦公司銷售工程師
- 台灣經濟研究院初級助理研究員
- 成功大學會計研究所財務組副教授
- 政治大學金融學系副教授
- FRM 證照 (金融風險管理師)

研究興趣

- 財務工程
- 衍生性商品
- 金融風險管理 教授課程
- 選擇權
- 衍生性商品
- 金融風險管理
- 新金融商品個案分析
- 金融市場

書籍著作

- 《期貨與選擇權：金融創新個案》
- 《選擇權：理論、實務與應用》
- 《衍生性金融商品：選擇權、期貨與交換》
- 《新金融商品個案集》
- 《金融衍生工具》(簡體版)

內容目錄

第一章 金融創新與商品案例

本網站中使用 cookie，欲查詢有關本網站使用 cookie 方式之詳情，及若您不希望電腦上使用 cookie 時應如何變更電腦的 cookie 設定，請參閱本網站「[隱私權條款](#)」之 Cookie 聲明。您繼續使用本網站即表示您同意本公司得按本網站使用條款之 Cookie 聲... [了解更多 >](#)

我知道了

1.4 金融創新商品案例

實務專欄 1：可轉換公司債：進可攻、退可守的商品

第二章 選擇權概述

- 2.1 選擇權的發展沿革
- 2.2 選擇權專有名詞介紹
- 2.3 選擇權日常生活實例
- 2.4 結合選擇權的產品實例

實務專欄 2：保本投資型外幣存款：增加外幣存款收益的商品

第三章 選擇權的價格及上下限

- 3.1 選擇權到期時的價值
- 3.2 選擇權到期前的價值
- 3.3 買權價格上下限
- 3.4 賣權價格上下限
- 3.5 影響選擇權價格的因素

實務專欄 3：雙元貨幣外幣投資組合：高收益外幣投資工具

第四章 買權賣權等價理論

- 4.1 買權賣權等價理論
- 4.2 買權賣權等價理論公式的解析
- 4.3 買權賣權等價理論公式的推導
- 4.4 等價理論與證券的複製
- 4.5 買權賣權等價理論之延伸

實務專欄 4：保本型共同基金：兼具保本與收益的商品

第五章 Black-Scholes 選擇權評價模型 (一)

- 5.1 Black-Scholes 買權評價公式
- 5.2 Black-Scholes 公式的意涵
- 5.3 Black-Scholes 賣權評價公式
- 5.4 Black-Scholes 公式中變數的選取
- 5.5 隱含波動度與笑狀波幅

實務專欄 5：修斯和莫頓研究選擇權的定價方法 獲得 1997 年的諾貝爾經濟學獎

第六章 波動度

- 6.1 歷史波動度
- 6.2 隱含波動度
- 6.3 波動度指數 VIX
- 6.4 黑天鵝指數
- 6.5 波動度交易策略

實務專欄 6：TRF 目標可贖回遠期契約：獲利有限 損失無窮的外匯商品

第七章 選擇權的交易策略

- 7.1 單一策略
- 7.2 避險策略
- 7.3 組合策略
- 7.4 價差策略

本網站中使用 cookie，欲查詢有關本網站使用 cookie 方式之詳情，及若您不希望電腦上使用 cookie 時應如何變更電腦的 cookie 設定，請參閱本網站「[隱私權條款](#)」之 Cookie 聲明。您繼續使用本網站即表示您同意本公司得按本網站使用條款之 Cookie 聲...
[了解更多 >](#)

我知道了

第八章 新奇選擇權

- 8.1 新奇選擇權導論
- 8.2 平均式選擇權
- 8.3 界限選擇權
- 8.4 回顧型選擇權
- 8.5 多因子選擇權
- 8.6 其他新奇選擇權

實務專欄 8：正反向利率連動公司債：滿足不同利率預期投資人的商品

第九章 股價指數選擇權與外匯選擇權

- 9.1 股價指數選擇權概述
- 9.2 股價指數選擇權的功能和價格
- 9.3 外匯選擇權的功能和評價
- 9.4 臺指選擇權市場

實務專欄 9：NDF 無本金交割遠期外匯：外匯市場匯率風向球

第十章 權證、利率債券及波動度選擇權及其評價

- 10.1 認購權證與認售權證
- 10.2 期貨選擇權
- 10.3 利率選擇權
- 10.4 波動度選擇權

實務專欄 10：聯邦資金利率期貨：預期 Fed 未來利率走勢的工具

第十一章 選擇權評價模型的分類

- 11.1 選擇權評價模型的分類
- 11.2 Black-Scholes 公式的一般化
- 11.3 美式選擇權提早履約條件與評價
- 11.4 平均式選擇權之評價

實務專欄 11：牛熊證：融資融券新工具

第十二章 Black-Scholes 選擇權評價模型 (二)

- 12.1 Black-Scholes 之前的評價模型
- 12.2 Black-Scholes 模型之假設
- 12.3 Black-Scholes 偏微分方程式之推導
- 12.4 由 CAPM 推導 Black-Scholes 偏微分方程式
- 12.5 由風險中立推導 Black-Scholes 公式

實務專欄 12：布萊克與修斯的生平介紹

第十三章 敏感度分析及避險策略

- 13.1 買權敏感度分析 (一)
- 13.2 買權敏感度分析 (二)
- 13.3 賣權敏感度分析
- 13.4 delta 中立避險策略
- 13.5 delta-gamma 中立避險策略

實務專欄 13：Index Bond 通貨膨脹連動債券：抗通膨利器

第十四章 二項式樹狀評價模型

本網站中使用 cookie，欲查詢有關本網站使用 cookie 方式之詳情，及若您不希望電腦上使用 cookie 時應如何變更電腦的 cookie 設定，請參閱本網站「[隱私權條款](#)」之 Cookie 聲明。您繼續使用本網站即表示您同意本公司得按本網站使用條款之 Cookie 聲... [了解更多 >](#)

我知道了

- 14.4 二項式評價法的應用：實質選擇權

實務專欄 14：二項式模型作者：Cox、Ross 及 Rubinstein

第十五章 蒙地卡羅模擬法

- 15.1 蒙地卡羅模擬法
 - 15.2 反向變異法及控制變異法加速收斂
 - 15.3 其他加速收斂方法
 - 15.4 美式蒙地卡羅模擬法
- 實務專欄 15：蒙地卡羅模擬法命名的由來

第十六章 金融風險管理導論

- 16.1 風險管理失敗案例
 - 16.2 長期資本管理公司破產事件
 - 16.3 2008 年全球金融海嘯
 - 16.4 風險的種類
- 實務專欄 16：避險基金：將會是下一個金融風暴的主角嗎？

第十七章 市場風險值的估算

- 17.1 風險值 (VAR) 簡介
 - 17.2 歷史模擬法
 - 17.3 標準差法
 - 17.4 蒙地卡羅法
 - 17.5 風險值的應用
- 實務專欄 17：Cat Bond 巨災債券：風險移轉新工具

第十八章 衍生性商品風險值的估算

- 18.1 期貨與遠期的 VAR
 - 18.2 選擇權的 VAR：完全評價法
 - 18.3 選擇權的 VAR：部分評價法
 - 18.4 波動度風險值
 - 18.5 交換與債券之 VAR 求法
 - 18.6 回溯測試與壓力測試
- 實務專欄 18：投資型保單：兼具保險與投資的商品

第十九章 流動性風險、信用風險及作業風險

- 19.1 流動性風險
 - 19.2 銀行的流動性風險管理
 - 19.3 信用風險
 - 19.4 信用風險的衡量
 - 19.5 信用計量法
 - 19.6 作業風險
- 實務專欄 19：CDS 信用違約交換：被視為 2008 年金融海嘯的幫兇

第二十章 金融創新商品個案

- 20.1 指數投資證券 ETN 個案
- 20.2 觸及出場遠期外匯合約 DKO 個案
- 20.3 VIX ETF 個案

本網站中使用 cookie，欲查詢有關本網站使用 cookie 方式之詳情，及若您不希望電腦上使用 cookie 時應如何變更電腦的 cookie 設定，請參閱本網站「[隱私權條款](#)」之 Cookie 聲明。您繼續使用本網站即表示您同意本公司得按本網站使用條款之 Cookie 聲... [了解更多 >](#)

我知道了

- 20.8 重設型認購權證個案

- 20.9 附賣回權股票個案
- 20.10 股利和資本利得受益憑證個案

★選擇權評價及交易策略軟體 2.2 版使用說明

ISBN: 9789869745284

商品規格

作者	陳威光
出版社	新陸書局
出版日期	2019/07/26
ISBN	9789869745284

本分類熱銷 全站排行



金融科技力(2021年版)
NT\$618



保險學原理精華版(5版)
NT\$551



程式交易(方法、技術與應用)
NT\$741



數位金融與金融科技(第3版)
NT\$475



金融市場全球的觀點(8版)
NT\$656



說這專頁讚 讓您買到滿意 分享



- 關於我們
- 品牌故事
- 商店簡介
- 門市資訊
- 隱私權條款

- 購物說明
- 付款方式
- 運送方式
- 退換貨方式

- 客服資訊
- 客服留言
- 常見問題
- 會員權益聲明
- 聯絡我們

官方APP

請輸入台灣手機號碼

免費傳送載點至手機

本網站中使用 cookie，欲查詢有關本網站使用 cookie 方式之詳情，及若您不希望在電腦上使用 cookie 時應如何變更電腦的 cookie 設定，請參閱本網站「[隱私權條款](#)」之 Cookie 聲明。您繼續使用本網站即表示您同意本公司得按本網站使用條款之 Cookie 聲...
[了解更多 >](#)

我知道了