

目錄

第一章	緒論	1
第二章	LIBOR 市場模型	6
	第一節 利率模型的發展概況	6
	第二節 建立 LIBOR 市場模型	8
	第三節 遠期 LIBOR 利率在不同計價單位下的動態過程	10
第三章	最小平方蒙地卡羅法(LSM)	11
	第一節 LSM 的適用時機	11
	第二節 LSM 的作法	13
	第三節 LSM 的實作範例	16
第四章	利率交換選擇權商品的評價及應用	22
	第一節 利用 LSM 評價百幕達式利率交換選擇權	22
	第二節 如何利用選擇權商品避險	33
第五章	結論	36
附錄		38
參考文獻		40

