

目錄 Table of contents

序	
作者序	
作者簡介	
作者相關書籍著作	
目錄	
圖、表目錄	

第一章 風險之本質與管理

1-1 前言	1-2
1-2 風險釋義	1-3
1-3 風險的來源	1-5
1-4 風險管理	1-12

第二章 風險管理概論

2-1 前言	2-2
2-2 風險管理的意義	2-3
2-3 風險管理的範圍與限制	2-5
2-4 風險管理的工具 – 衍生性商品	2-10
2-5 風險管理的發展	2-12

第三章 金融機構風險管理沿革

3-1 前言	3-2
3-2 巴賽爾協定對銀行的規範	3-3
3-3 標準模型	3-11
3-4 內部模型	3-26
3-5 其他模型與標準	3-35
3-6 1999 年 BIS 的新資本適足率規範提議	3-37
3-7 IOSCO 的規定-非銀行金額機構	3-41

第四章 風險值介紹

4-1 前言	4-2
4-2 風險值的意義	4-3
4-3 風險值估算方法	4-6
4-4 絕對風險值與相對風險值	4-9
4-5 風險值參數選擇	4-12
4-6 壓力測試	4-17
4-7 回溯測試	4-21

第五章 變異數-共變異數法

5-1 前言	5-2
5-2 單一資產風險值	5-3
5-3 投資組合的風險值	5-7
5-4 常態分配的便利性	5-15
5-5 非線性風險來源	5-18
5-6 波動性估計	5-25

第六章 歷史模擬法

6-1 前言	6-2
6-2 歷史模擬法程序	6-3
6-3 歷史模擬法實例	6-8
6-4 歷史模擬法的優缺點	6-10
6-5 修正方法	6-13

第七章 蒙地卡羅模擬法

7-1 前言	7-2
7-2 產生隨機亂數	7-3
7-3 單一資產模擬	7-7
7-4 投資組合模擬	7-17

7-5 選擇權價格模擬	7-25
附錄一	7-29
附錄二	7-30

第八章 績效評估與資本配置

8-1 前言	8-2
8-2 風險與績效	8-3
8-3 風險與資本	8-12

第九章 券商風險管理機制與架構

9-1 前言	9-2
9-2 券商面臨的風險	9-3
9-3 機構風險管理案例與趨勢	9-7
9-4 市場風險管理模式及機制	9-11
9-5 我國現行法令規定及狀況	9-18
附錄 證券商之市場風險管理程序及活動	9-23

第十章 信用矩陣

10-1 前言	10-2
10-2 信用矩陣發展的背景	10-3
10-3 信用矩陣的基本概念	10-7
10-4 信用矩陣與風險矩陣的關係	10-8
10-5 信用矩陣的架構與運作原理	10-10
10-6 信用矩陣的實例運用	10-14
10-7 信用矩陣在其他金融工具的應用	10-25
10-8 信用矩陣的運用限制	10-27
10-9 結語	10-32