

目錄

序

Part 1 金融機構 1

Chapter1 金融機構概論 3

- 1.1 認識金融市場 4
- 1.2 金融市場的參與機構 6
- ✿ 金融新視野：目標到期債券基金 國際夯 13
- 1.3 全書導覽 24

Chapter 2 金融控股公司、商業銀行與保險公司 31

- 2.1 金融控股公司 32
- 2.2 商業銀行 41
- ✿ 金融新視野：金融服務轉型勢在必行 49
- 2.3 保險公司 50

Chapter 3 證券商與期貨商 67

- 3.1 證券商 68
- ✿ 金融新視野：如何降低詢價圈購的弊端 75
- 3.2 證券商周邊機構與主管機關 80
- 3.3 期貨市場機構 84

Chapter 4 共同基金與對沖基金 95

- 4.1 共同基金的基本特性與類型 96
- 4.2 共同基金的發展與監管 106
 - ✿ 金融新視野：AI 上陣 貝萊德裁經理人 121
- 4.3 對沖基金的基本特性與類型 123
 - ✿ 金融新視野：投資型對沖基金指數及對沖基金 ETF 132
- 4.4 對沖基金的發展與監管 134

Part 2 風險衡量與管理 145

Chapter 5 金融機構的經營與風險 147

- 5.1 金融創新 148
- 5.2 金融科技的興起 153
 - ✿ 金融新視野：金融機構如何因應行動支付市場的崛起 155
- 5.3 金融機構的國際化策略 161
 - ✿ 金融新視野：配合新南向 金融業的挑戰與機會 164
- 5.4 金融機構的經營風險 166
 - ✿ 金融新視野：ATM 開後門遭盜領 FinTech 發展摔跤 170

Chapter 6 利率及匯率風險管理 179

- 6.1 利率風險的衡量 180
- 6.2 利率風險的管理——免疫法 188
- 6.3 利率風險的管理——利率衍生性金融商品 195
- 6.4 匯率風險之衡量與管理 203
 - ✿ 金融新視野：台灣壽險業的外匯價格變動準備金機制 204

Chapter 7 市場風險管理 217

- 7.1 投資組合的風險 218
- 7.2 市場風險的衡量系統——風險值 225
- 7.3 變異數／共變異數法 229
 - ✿ 金融新視野：Copula-VaR 233
- 7.4 歷史模擬法及蒙地卡羅模擬法 236
- 7.5 巴塞爾資本協定之標準法 239

Chapter 8 信用與流動性風險管理 255

- 8.1 信用風險的衡量——風險值 256
- 8.2 信用風險的衡量——巴塞爾資本協定 261
- 8.3 信用風險的管理 269
- 8.4 流動性風險的衡量與管理 280
 - ✿ 金融新視野：大陸伊利諾銀行倒閉危機 285

Chapter 9 金融機構的監督與管理 295

- 9.1 巴塞爾資本協定 296
- 9.2 台灣的金融監理概況 305
 - ✿ 金融新視野：2010年美國金融改革法案 314
 - ✿ 金融新視野：英國金融監理改革的啟示 317
- 9.3 存款保險制度 318
- 9.4 《金融消費者保護法》 322

中文索引 331

英文索引 341