

目錄

三版序

Part I 概論與機構篇 1

Chapter 1 證券市場概論 3

1.1 證券市場的功能與重要性 4

☼ 證券市場專欄：鬆綁票券業法令 助台金融發展
6

1.2 證券市場的商品種類 9

1.3 發行市場與流通市場 10

1.4 證券市場的參與者 15

觀念摘要 19

本章習題 21

Chapter 2 證券市場的參與機構 23

2.1 主管機關與交易市場管理機構 24

2.2 證券商與期貨商 26

☼ 證券市場專欄：證券商如何因應金融 3.0 的浪潮
28

2.3 證券周邊事業 30

☼ 證券市場專欄：證券投資人保護制度 38

2.4 對沖基金及私募股權基金 40

觀念摘要 46

本章習題 48

Part II 金融商品篇 51

Chapter 3 權益證券 53

3.1 普通股 54

☉ 證券市場專欄：股東行動主義的興起 58

3.2 特別股 65

3.3 存託憑證 68

觀念摘要 70

本章習題 72

Chapter 4 短期票券與債券 75

4.1 短期票券的意義與種類 76

4.2 債券的意義與種類 80

4.3 可轉換公司債 88

4.4 證券化商品 93

☉ 證券市場專欄：籌資新工具——資產擔保商業本票 96

觀念摘要 100

本章習題 102

Chapter 5 衍生性金融商品 107

5.1 遠期契約與期貨契約 108

5.2 選擇權契約 118

☉ 證券市場專欄：人民幣急貶重創 TRF 122

5.3 認購（售）權證 127

觀念摘要 138

本章習題 140

Chapter 6 共同基金 145

6.1 共同基金的發行架構與特性 146

6.2 共同基金的基本類型 147

6.3 共同基金的特殊類型 155

6.4 共同基金的交易實務 162

☉ 證券市場專欄：櫃檯買賣中心的開放型基金交易
平台 166

觀念摘要 170

本章習題 172

Part III 發行市場篇 177

Chapter 7 股票發行實務 179

7.1 公開發行與初次上市（櫃） 180

7.2 股票承銷制度 181

☉ 證券市場專欄：如何降低詢價圈購的弊端 190

7.3 其他股票發行相關規範 190

觀念摘要 198
本章習題 200

Chapter 8 短期票券與債券發行實務 203

8.1 短期票券發行實務 204
8.2 政府公債發行實務 207
8.3 金融債券與公司債發行實務 212
8.4 外國債券與國際債券發行實務 216
觀念摘要 219
本章習題 221

Chapter 9 發行市場與上市（櫃）公司的管理 225

9.1 資訊公開制度 226
● 證券市場專欄：善用公開資訊觀測站 232
9.2 公司內部人股權管理制度 232
9.3 內線交易及短線交易規範 236
9.4 公司治理 239
9.5 下市（櫃）機制 243
觀念摘要 248
本章習題 250

Part IV 流通市場篇 255

Chapter 10 股票交易實務 257

10.1 台灣股市的結構與發展概況 258

☉ 證券市場專欄：國際股市的發展 264

10.2 股票交易流程 265

☉ 證券市場專欄：未來股票盤中撮合方式將改成逐筆競價 270

10.3 股票之其他交易型態 275

10.4 股票市場監視制度 280

觀念摘要 283

本章習題 285

Chapter 11 短期票券與債券交易實務 289

11.1 短期票券交易實務 290

11.2 債券買賣斷交易與附條件交易 292

☉ 證券市場專欄：如何使用櫃檯買賣中心的「殖利率／百元價格換算」工具 300

11.3 債券之其他交易型態 306

11.4 可轉換公司債的套利與資產交換 310

觀念摘要 314

本章習題 316

Chapter 12 信用交易與借券交易實務 319

12.1 信用交易實務 320

12.2 擔保維持率 323

12.3 信用交易相關規範 327

12.4 借券交易 331

☉ 證券市場專欄：外資借券錯了嗎？ 336

觀念摘要 340
本章習題 342

選擇題解答 347
中英文索引 349