

证券投资分析：第八章金融工程应用分析证券从业资格考试
PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/597/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E6_8A_95_E8_c33_597950.htm

第一节 金融工程概述

加入收藏 一、金融工程的基本概念 二、金融工程的技术与

运作（一）金融工程技术1、无套利均衡分析技术2、分解、

组合与整合技术（二）金融工程的运作六个阶段三、金融工

程的运用（一）公司理财（二）金融工具交易（三）投资管

理（四）风险管理第二节 期货的套期保值与套利 一、期货的

套期保值（一）套期保值基本概念与原理（二）套期保值方

向1、买进套期保值2、卖出套期保值（三）基差对套期保值

效果的影响（四）股指期货套期保值交易 设为首页 1、套期

保值时机2、规避工具的选择3、期货合约数量的确定（五）

套期保值的原则反向、同品、等值、同时二、套利原则（一）

套利基本原理（二）套利交易对期货市场的作用（三）套

利的风险1、政策风险2、市场风险3、操作风险4、资金风险

（四）股指期货套利的基本原理与方式1、期现套利2、市场

内价差套利3、市场间价差套利4、跨品种价差套利（五）套

期保值与套现保值的区别第三节 VAR方法 一、VAR方法的历史

演变 二、VAR方法的基本原理及计算方法（一）VAR计算的

基本原理（二）VAR主要计算方法局部估值法和完全估值

法1、德尔塔-正态分布法2、历史模拟法3、蒙特卡罗模拟法

三、VAR方法的应用（一）风险管理与控制（二）基于VAR

法的资产配置与投资决策（三）基于VAR法的业绩评价（四）

风险监管四、使用VAR方法须注意的问题没有最坏的损失

误差头寸变化 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载

。详细请访问 www.100test.com