

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\\_ti2020/645/2021\\_2022\\_\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_88\\_B8\\_E6\\_8A\\_95\\_E8\\_c33\\_645128.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/645/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E6_8A_95_E8_c33_645128.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](http://www.100test.com)