

# 財務工程十本最佳書籍

Best 10 Books On Financial Engineering

昀騰金融科技

技術長

董夢雲 博士

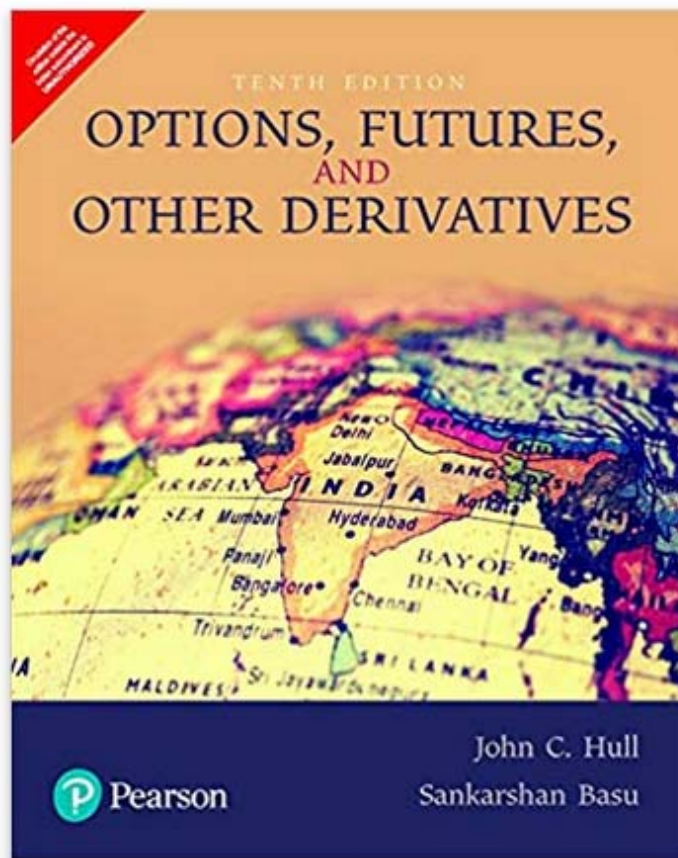
[dongmy@ms5.hinet.net](mailto:dongmy@ms5.hinet.net)

## ◆ 選書原則

- 本人有實體書，也讀過的為對象
- 與財務理論的實作有關，財務工程是也
- 理論公式說明優秀
- 實作細節交代清楚
- 讀完有益身心，無副作用

◆ 1. "Options, Futures, and Other Derivatives.", John Hull, 10th ed., 2018.

➤ 全面性的介紹，即時的更新，初學者必備的書籍。

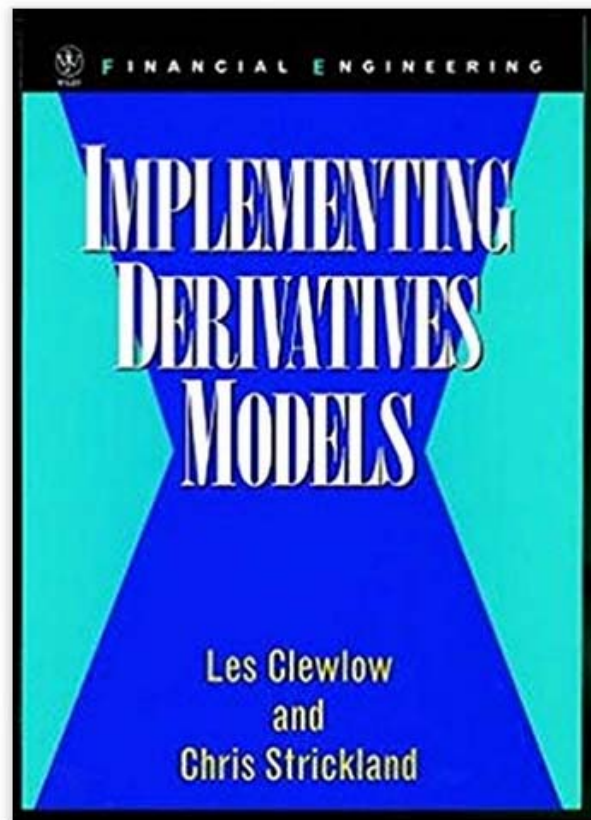


ISBN-13: 978-9352866595

ISBN-10: 9789352866595

◆ 2. "Implementing Derivative Models", Les Clewlow and Chris Strickland, 1998.

- 對於程式實作的數值演算法，Tree、Simulation 有詳細的說明，尤其利率模型的交代非常透徹，包括市場校正，是財工入門者必備書籍。最近的理論沒有反應，Heston Model, LMM 沒有談到。

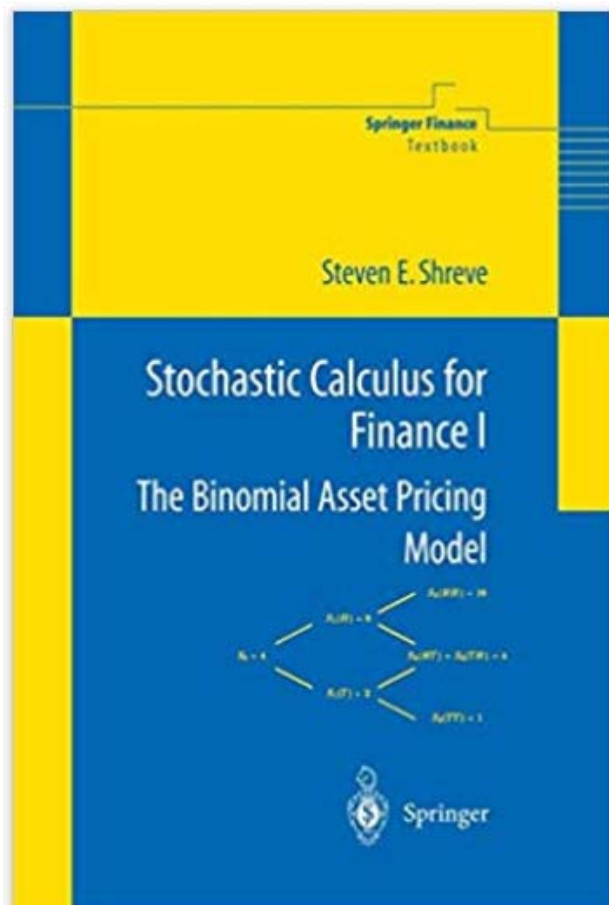


ISBN-13: 978-0471966517

ISBN-10: 0471966517

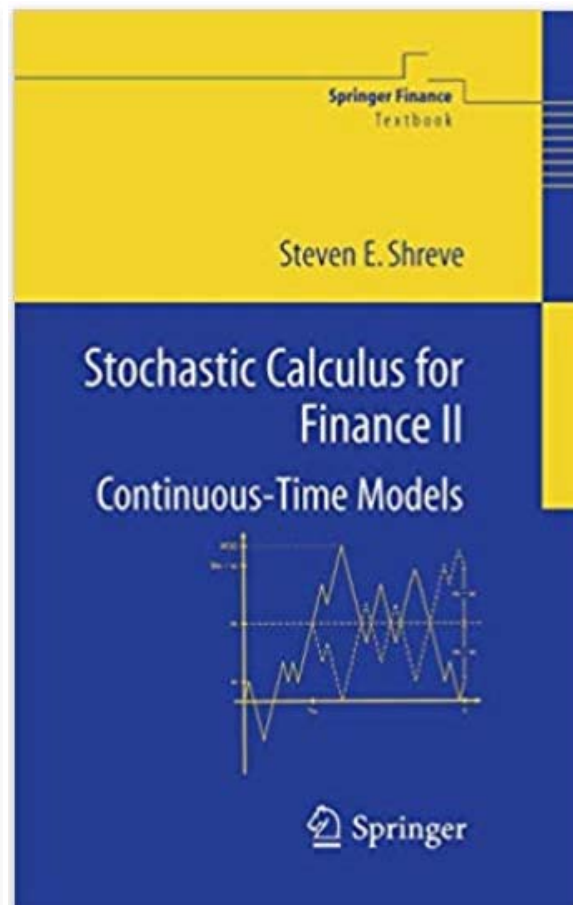
◆ 3. "Stochastic Calculus for Finance I & II.", Steven Shreve.

➤ 數學大師的解惑之作，必讀的經典。



ISBN-13: 978-0387249681

ISBN-10: 0387249680

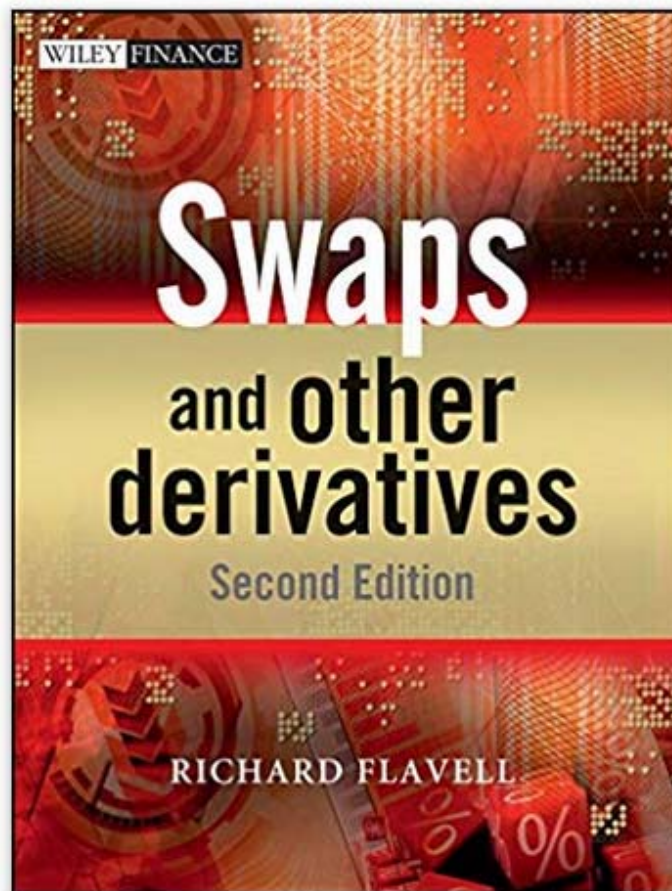


ISBN-13: 978-0387401010

ISBN-10: 0387401016

◆ 4. "Swaps and Other Derivatives.", Richard Flavell.

➤ 實務專家的實踐經驗，利率模型的實作範例，不可不看。本人曾受教於新加坡。



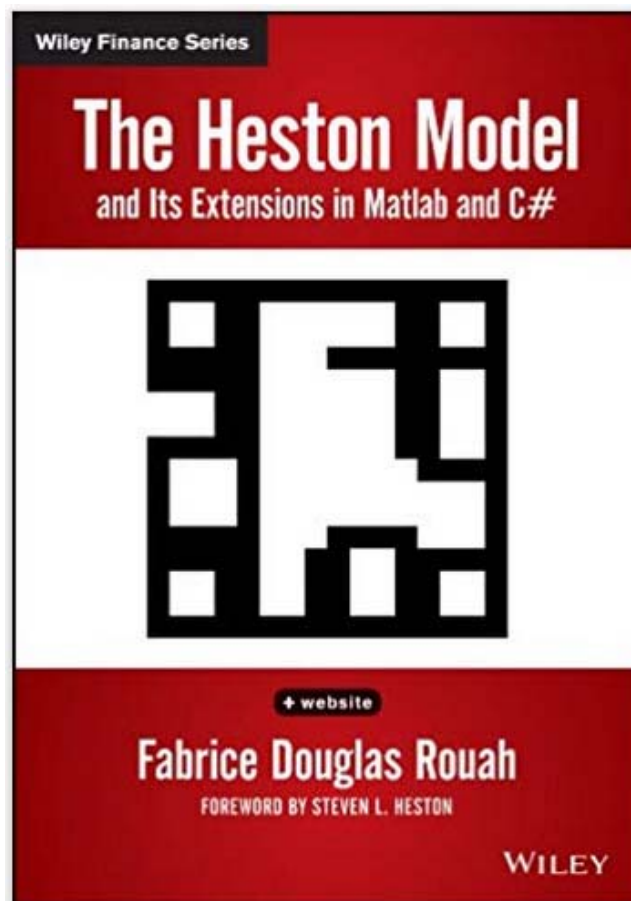
ISBN-13: 978-0470721919

ISBN-10: 047072191X

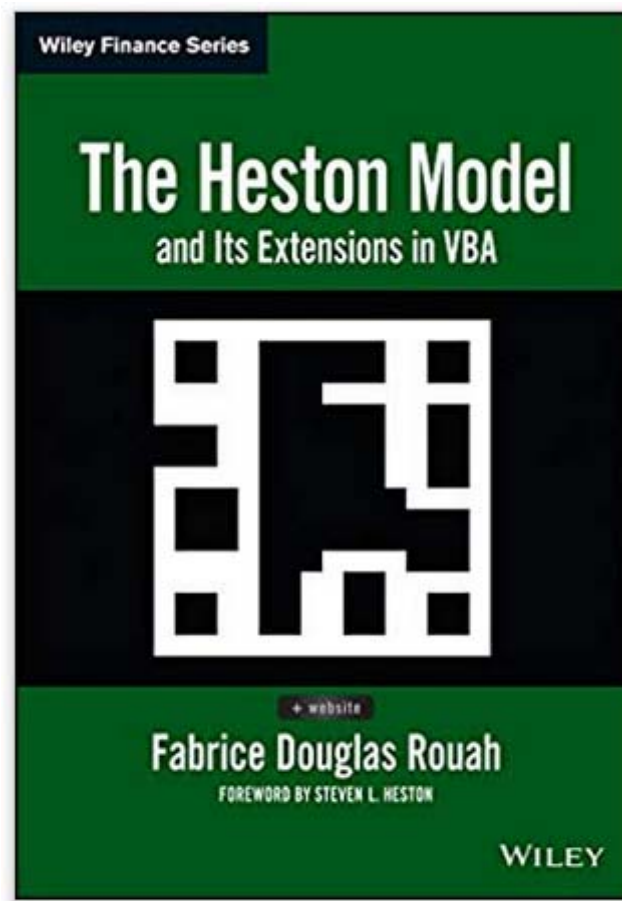


◆ 5. "The Heston Model and Its Extensions in Matlab and C#.", Fabrice Rouah.

➤ 隨機波動模型的經典之作，有程式範例，必讀精品。有 VBA 版。



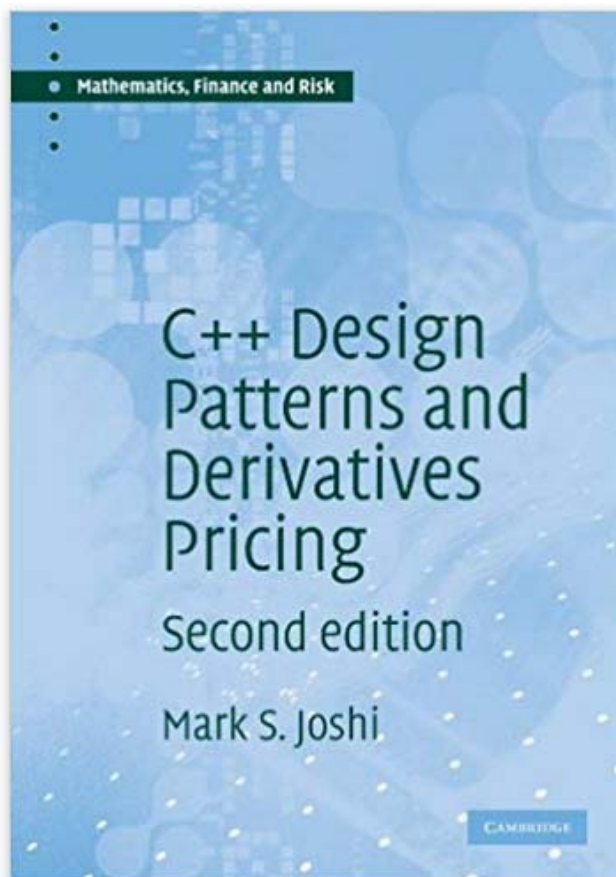
ISBN-13: 978-1118548257  
ISBN-10: 1118548256



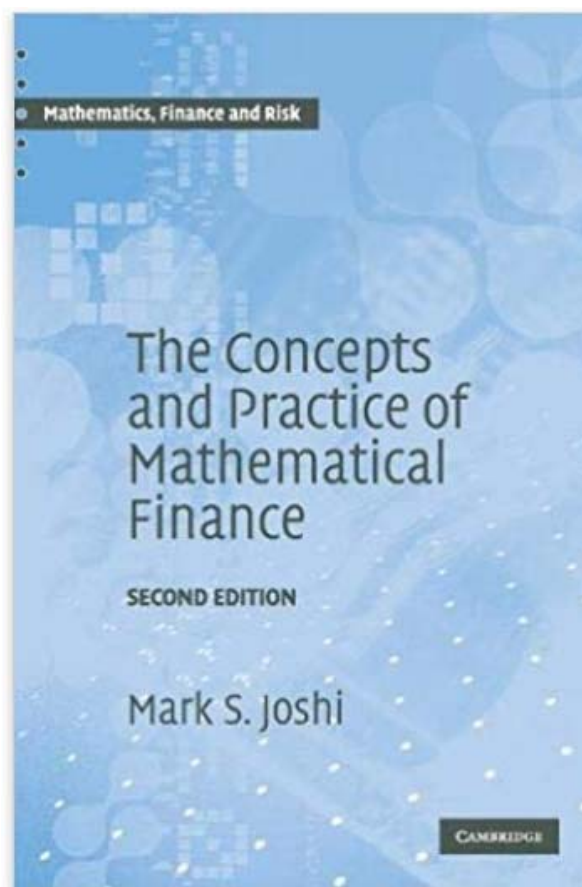
ISBN 13 碼: 978-1119003304  
ISBN 10 碼: 111900330X

◆ 6. "C++ Design Patterns and Derivatives Pricing.", Mark Joshi, 2nd. ed..

➤ 大師之作，豈可遺珠，任何嚴格的財工人員，必讀之書。



**ISBN-13:** 978-0521721622  
**ISBN-10:** 0521721628

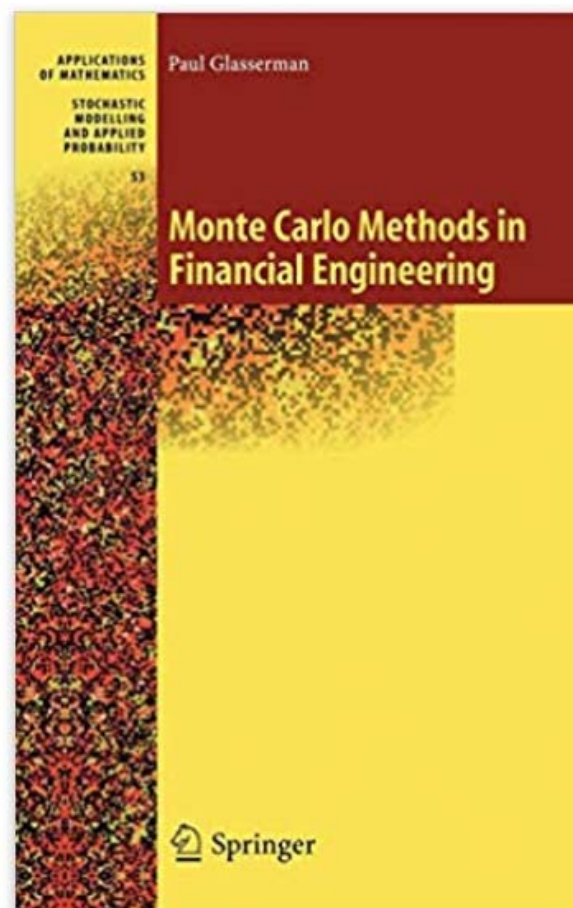


**ISBN-13:** 978-0521514088  
**ISBN-10:** 0521514088



◆ 7. "Monte Carlo Methods in Financial Engineering.", Paul Glasserman.

➤ 對模擬法有全面深刻的介紹，經典之著，必讀。

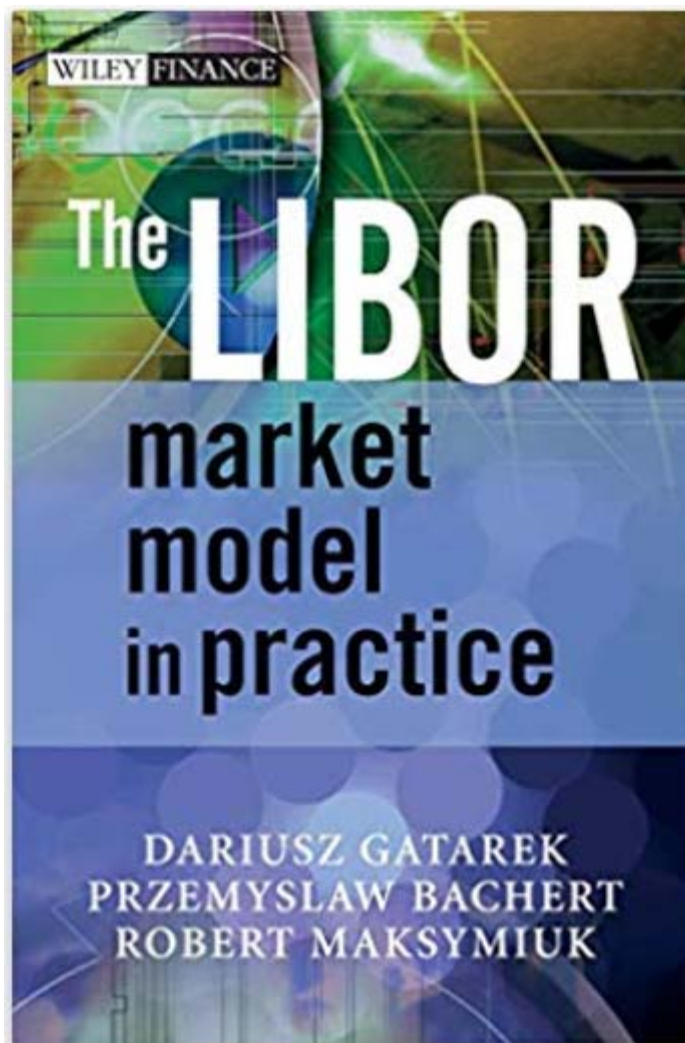


ISBN-13: 978-0387004518

ISBN-10: 0387004513

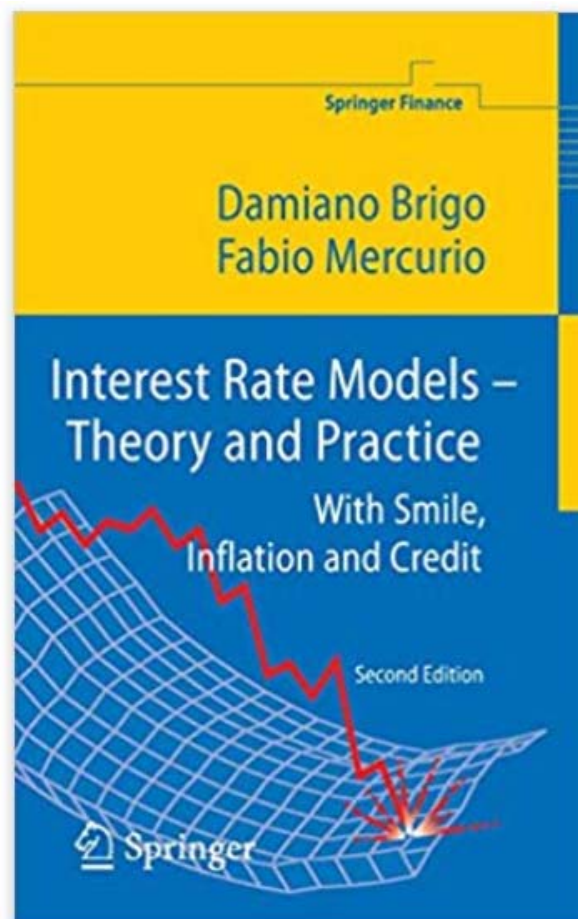
◆ 8. "The LIBOR Market Model in Practice.", Dariusz Gatarek.

- "BGM"中 G 的大作，對 LMM 的實作有很詳細的說明，第一版 typo 不少。



◆ 9. "Interest Rate Models: Theory and Practice.", Damiano Brigo, 2nd ed..

➤ 利率大師的經典著作，理論與實務兼具，必讀。

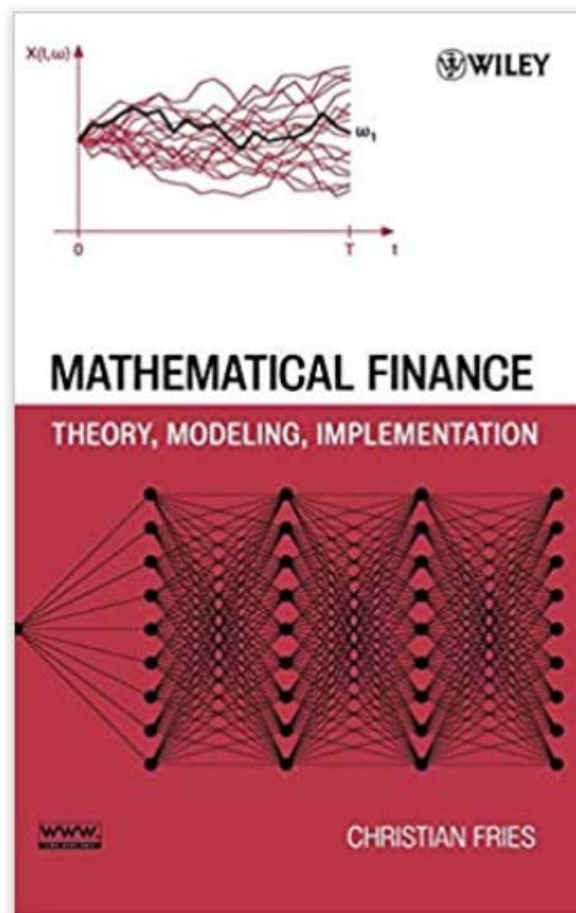


ISBN-13: 978-3540221494

ISBN-10: 3540221492

◆ 10. "Mathematical Finance : Theory, Modeling, Implementation.", Christian Fries.

➤ 程式高手的財務之作，似乎已入無人之境。

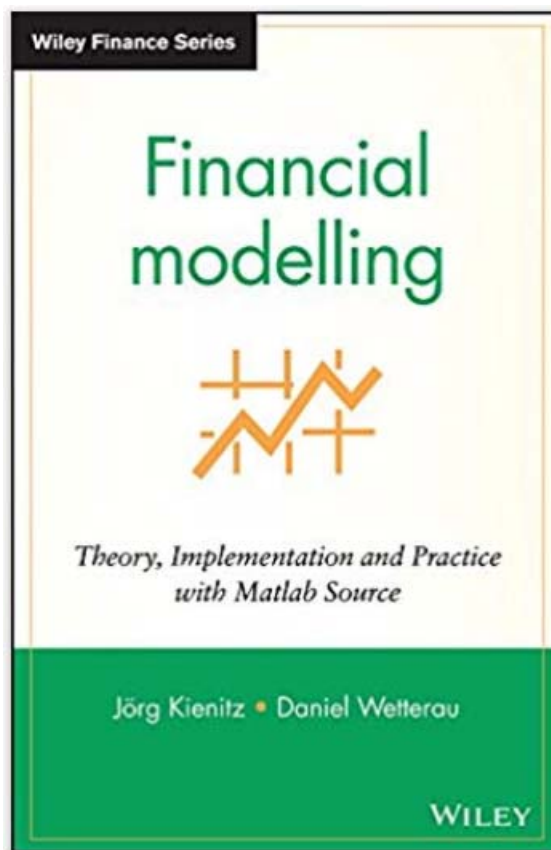


ISBN-13: 978-0470047224

ISBN-10: 0470047224

◆ 補遺 1. "Financial Modelling : Theory, Implementation and Practice with MATLAB Source.", Jorg Kienitz Wetterau.

➤ Kienitz 的理論深度令人佩服，書中的討論議題都是關鍵，美中不足的是只有 Matlab Code。



ISBN-13: 978-0470744895

ISBN-10: 0470744898



◆ 補遺 2. "Interest Rate Derivatives Explained: Volume 1 & 2.", Jorg Kienitz & Peter Caspers.

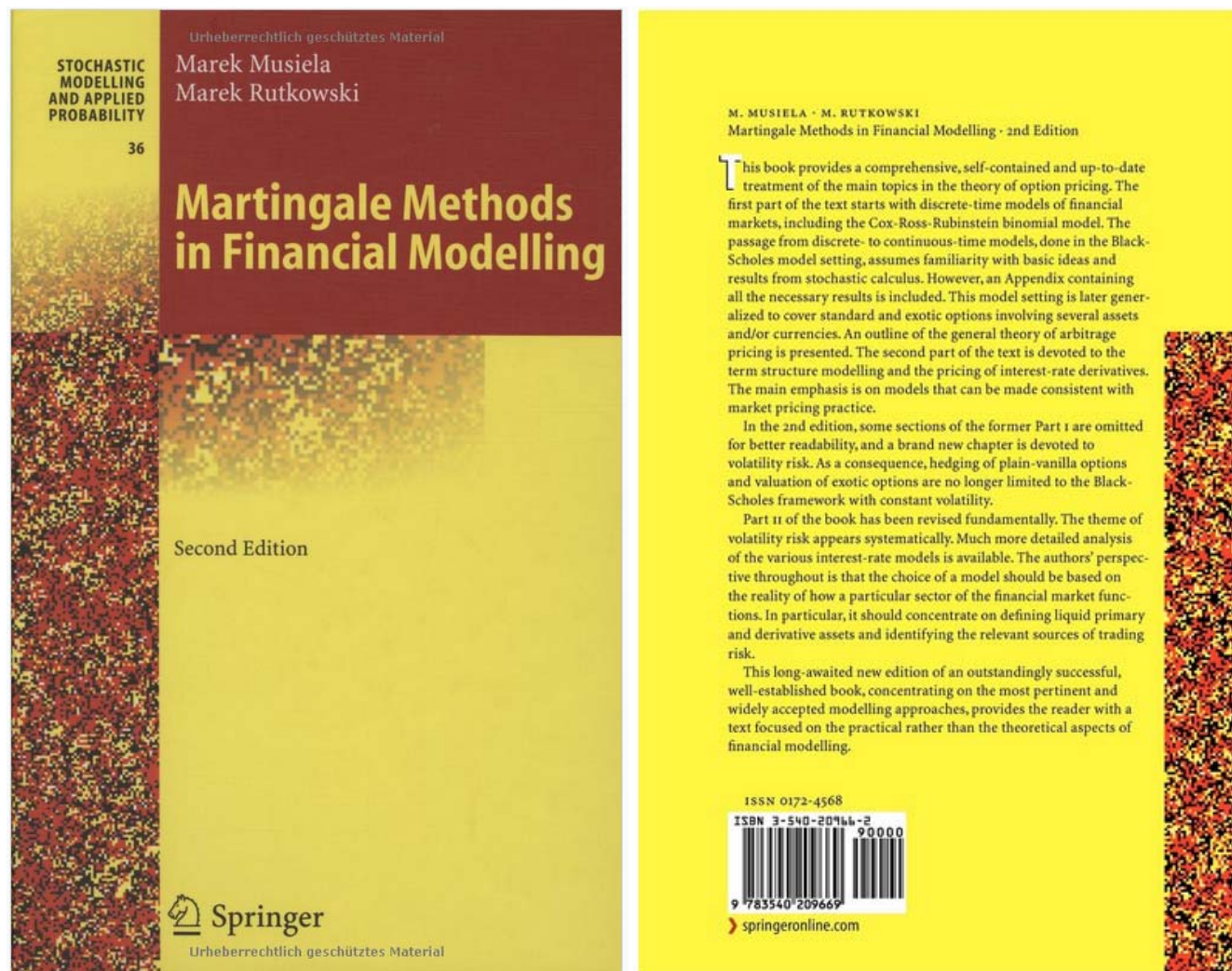
➤ Kienitz 再接再厲，討論利率衍生商品的實務面議題，這在目前市場上是非常需要的。





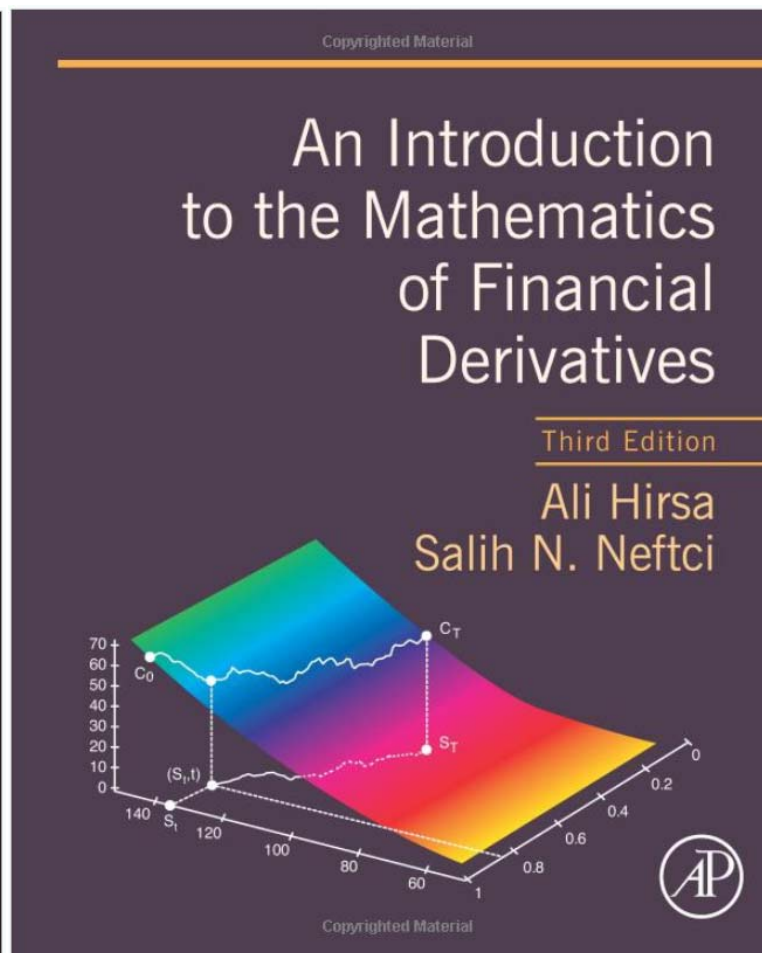
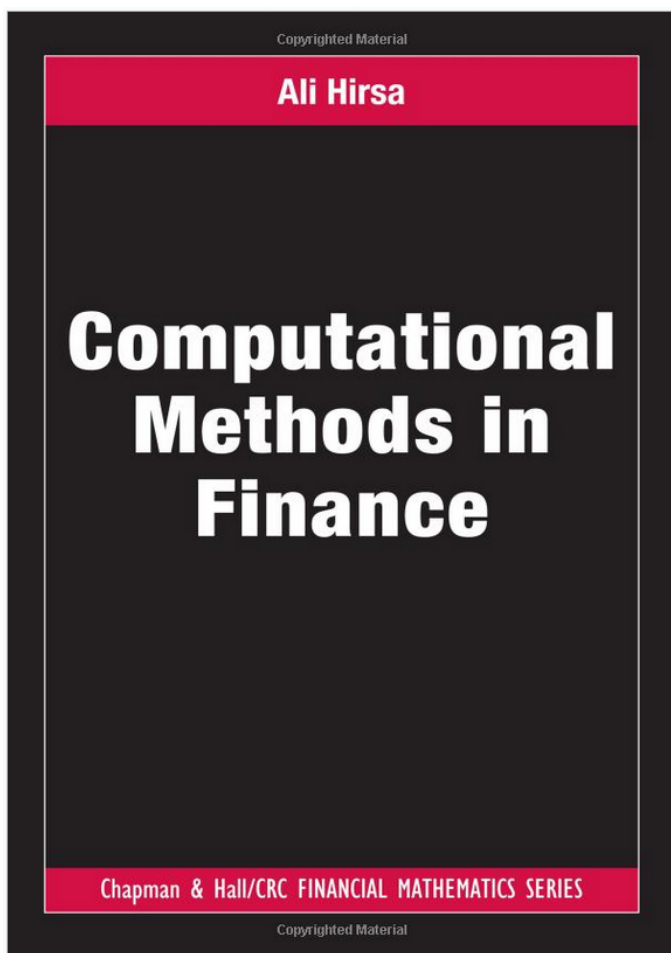
### ◆ 補遺 3. "Martingale Methods in Financial Modelling.", Marek Musiela & Marek Rutkowski.

➤ BGM 中的 M，討論利率衍生商品的理論模型，第二版相當全面豐富。



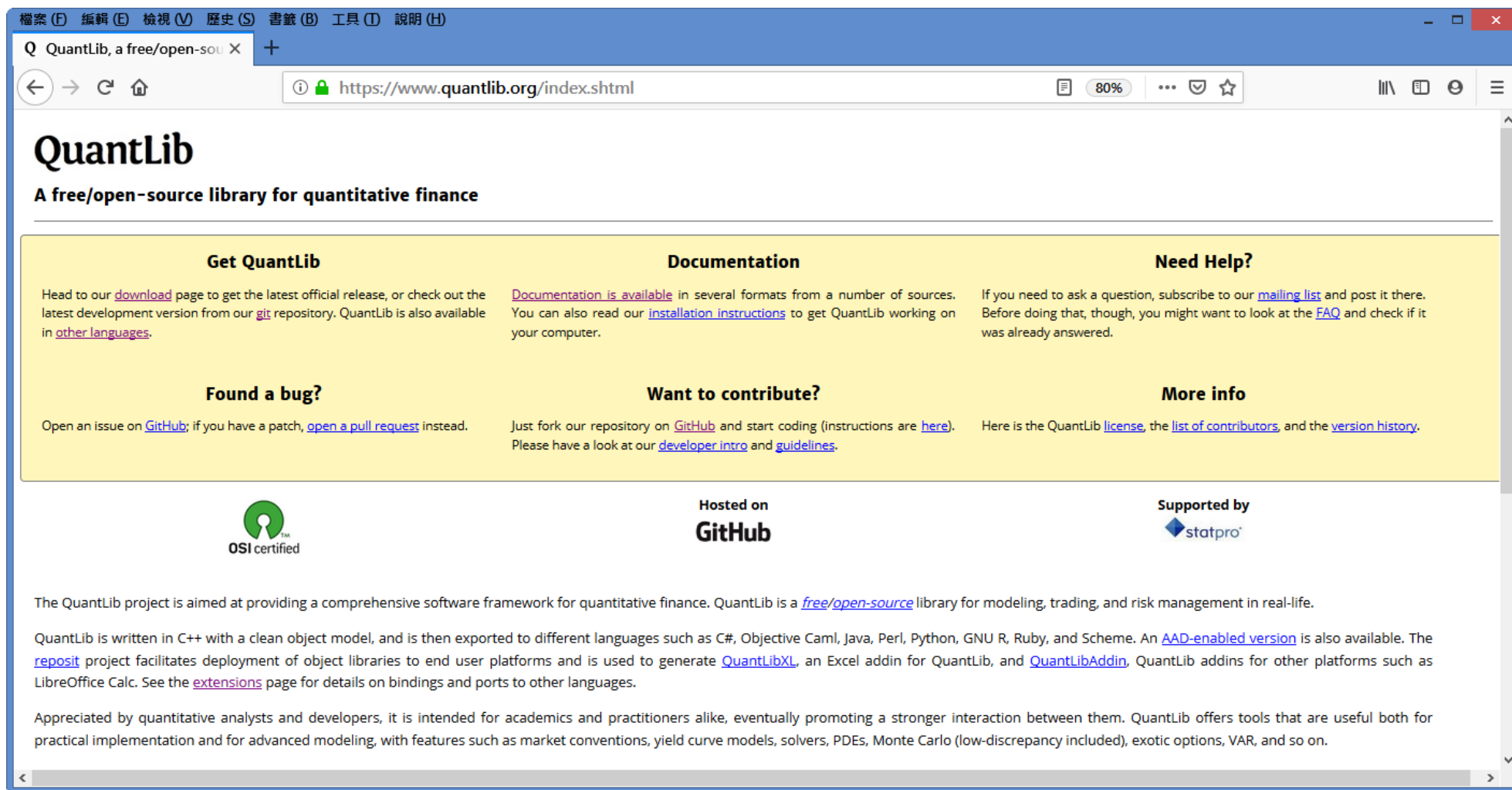
◆ 補遺 4. "Computational Methods in Finance.", Ali Hirs.

- Hirs 與 Salih Neftci 合著的 "An Introduction to the Mathematics of Financial Derivatives, 3<sup>rd</sup> ed." 是  
很好的入門書，本書的深度相當高，可以補足前者的不足。



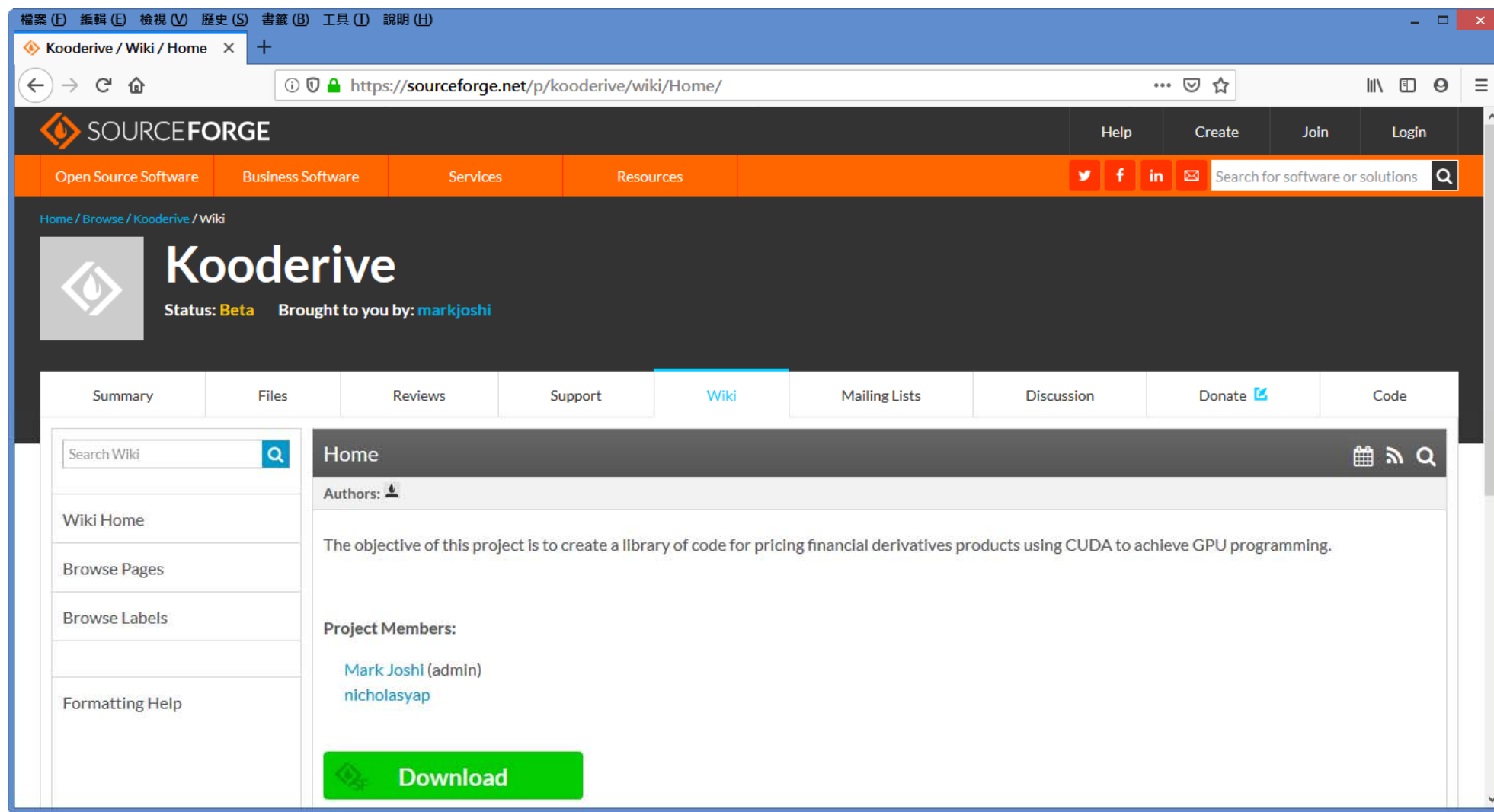
## ◆ QuantLib : A free/open-source library for quantitative finance.

➤ 財務理論的整體實踐，人類智慧的結晶。



## ◆ Kooderive : QuantLib 中 LMM 實作專家 Mark Joshi 的番外篇。

➤ Mark Joshi 留給大家無限的懷念，LMM 的 GPU 實踐。財工領域的聖母峰。





# 昀騰金融科技股份有限公司

技術長  
金融博士、證券分析師

董夢雲 Andy Dong



ID:50917111

Line/WeChat:andydong3137

E:andydong1209@gmail.com

<https://github.com/andydong1209>

M:(T)0988-065-751 (C)1508-919-2872

10647 台北市大安區辛亥路一段 50 號 4 樓

## 學經歷

國立台灣大學電機工程學系學士

國立中央大學財務管理學研究所博士

中國信託商業銀行交易室研發科主管

凱基證券風險管理部主管兼亞洲區風險管理主管

中華開發金控、工業銀行風險管理處處長

永豐金控、商業銀行風險管理處處長

永豐商業銀行結構商品開發部副總經理

## 專業

證券暨投資分析人員合格(1996)

台灣金融研訓院 2019 年菁英講座

## 專長

風險管理理論與實務，資本配置與額度規劃、資產負債管理實務

外匯與利率結構商品評價實務，股權與債權及衍生商品評價實務

GPU 平行運算與結構商品系統開發，CUDA、OpenCL

CPU 平行運算與 ALM 系統開發，C#/C++/C、.Net Framework、SQL

人工智慧(Deep Learning)交易策略開發，Python、Keras、TensorFlow