

財務工程十本最佳實作書籍

Best 10 Books On Financial Engineering Implementation

昀騰金融科技

技術長

董夢雲 博士

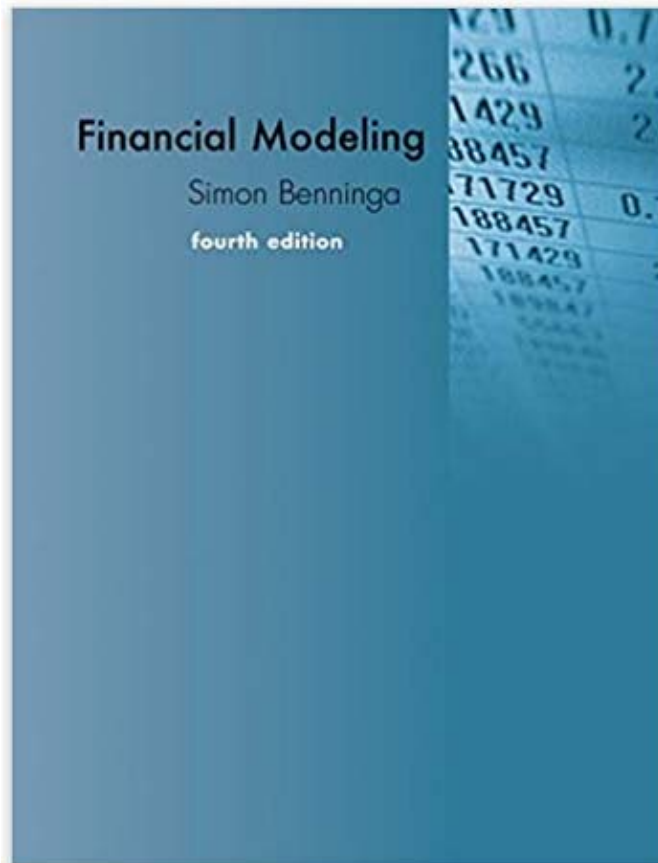
dongmy@ms5.hinet.net

◆ 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
- 要有程式碼
- 結構清晰，清楚交代實作細節
- 讀完有益身心，無副作用

◆ 1. "Financial Modeling.", Simon Benninga, 4th ed..

- MIT 教授的實務之作，影響無數的財務人員。

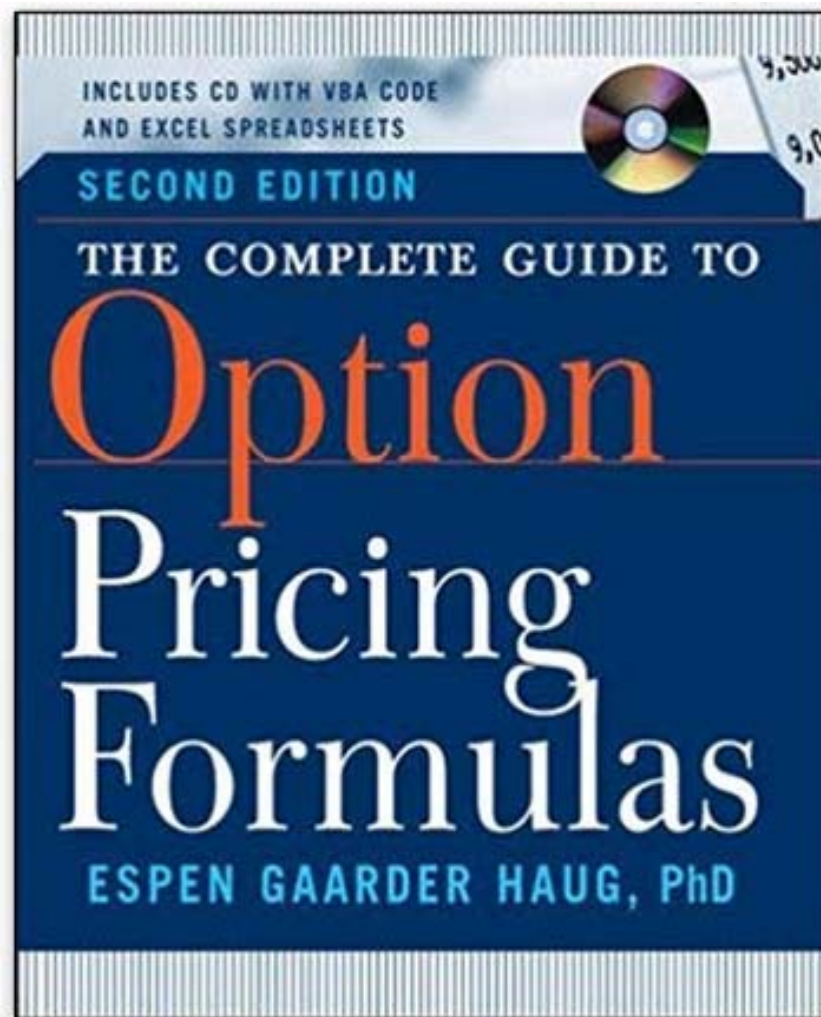


ISBN-13: 978-0262027281

ISBN-10: 0262027283

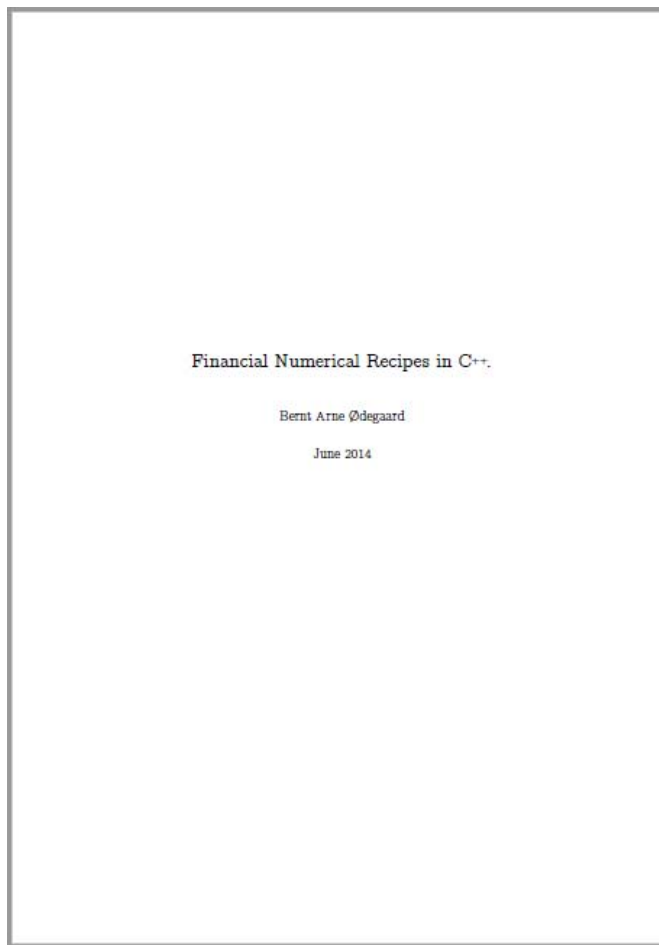
◆ 2. "The Complete Guide to Option Pricing Formulas.", Espen Gaarder Haug, 2nd ed..

➤ 入門書節，有相當完整的選擇權公式 VBA 程式碼，以解析解為主，初學者必備的書籍。



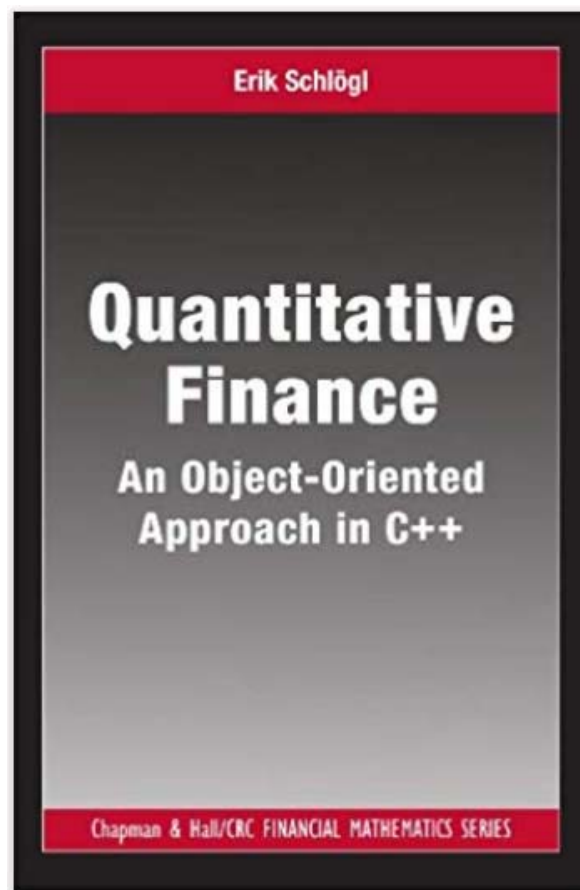
◆ 3. "Financial Numerical Recipes in C++.", Bernt Arne Odegaard.

- http://www1.uis.no/ansatt/odegaard/gcc_prog/index.html 。
- 來自挪威的學者無私的貢獻，全面性的介紹，是財工入門者必備書籍。



◆ 4. "Quantitative Finance: An Object-Oriented Approach in C++.", Erik Schlögl.

➤ Schlögl 的實踐佳作，作者在 LMM 有相當的研究。

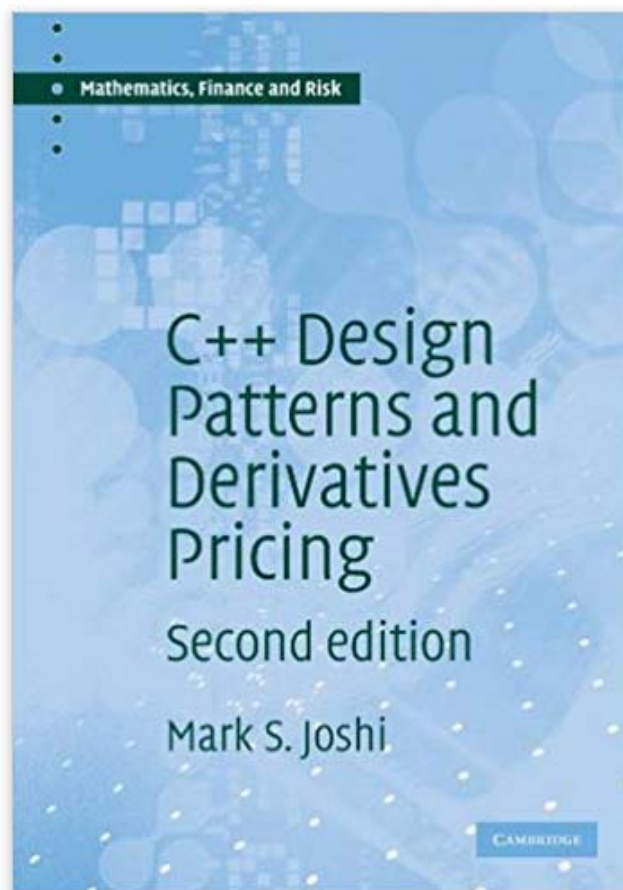


ISBN-13: 978-1584884798

ISBN-10: 1584884797

◆ 5. "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。

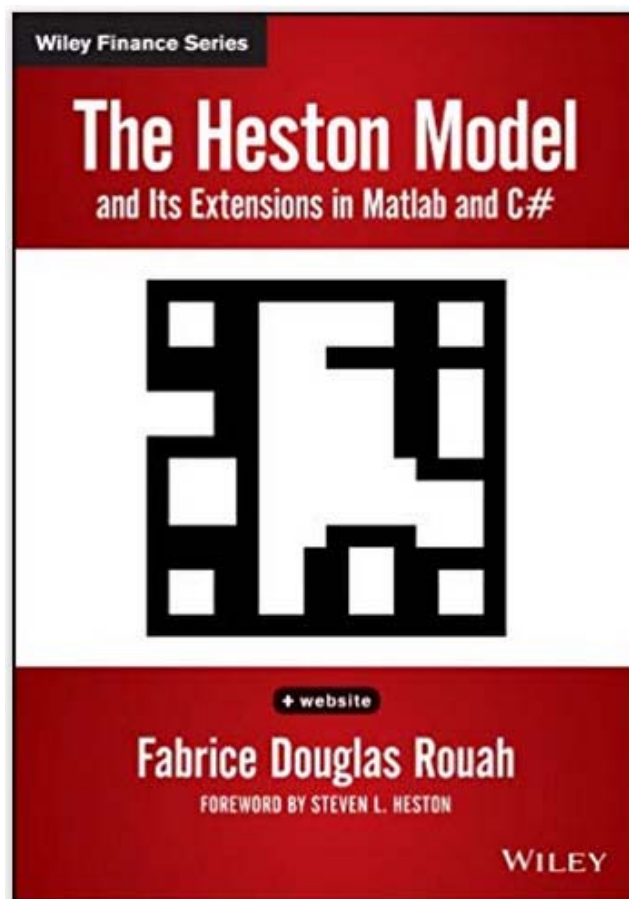


ISBN-13: 978-0521721622

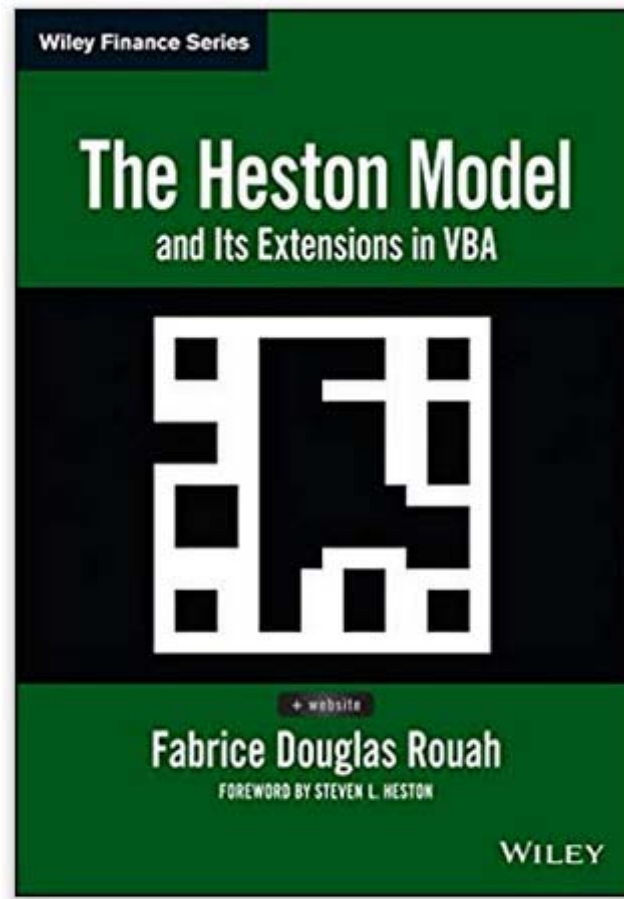
ISBN-10: 0521721628

◆ 6. "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。



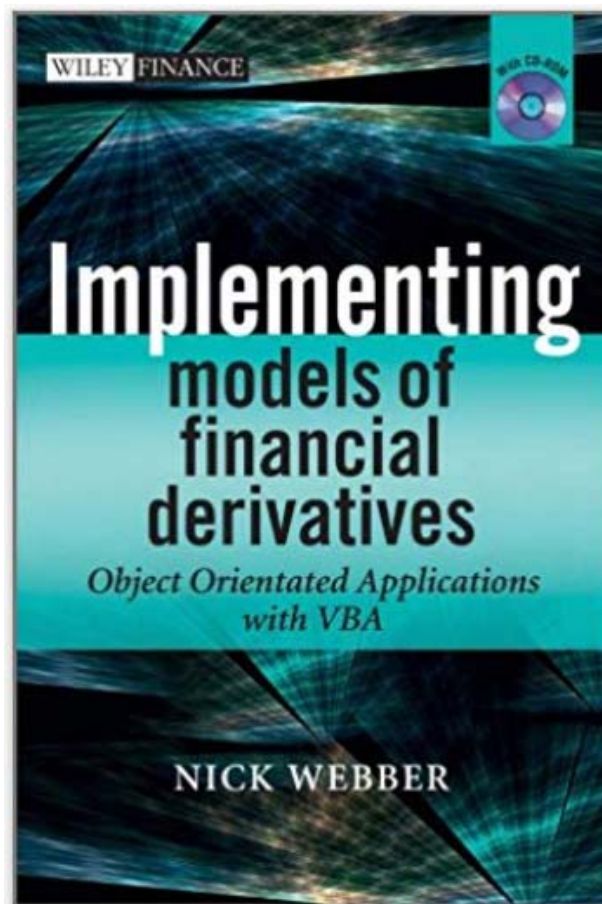
ISBN-13: 978-1118548257
ISBN-10: 1118548256



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

◆ 7. "Implementing Models of Financial Derivatives.", Nick Webber.

➤ LSMC 實踐經驗，利率模型專家的 Webber 的力作。

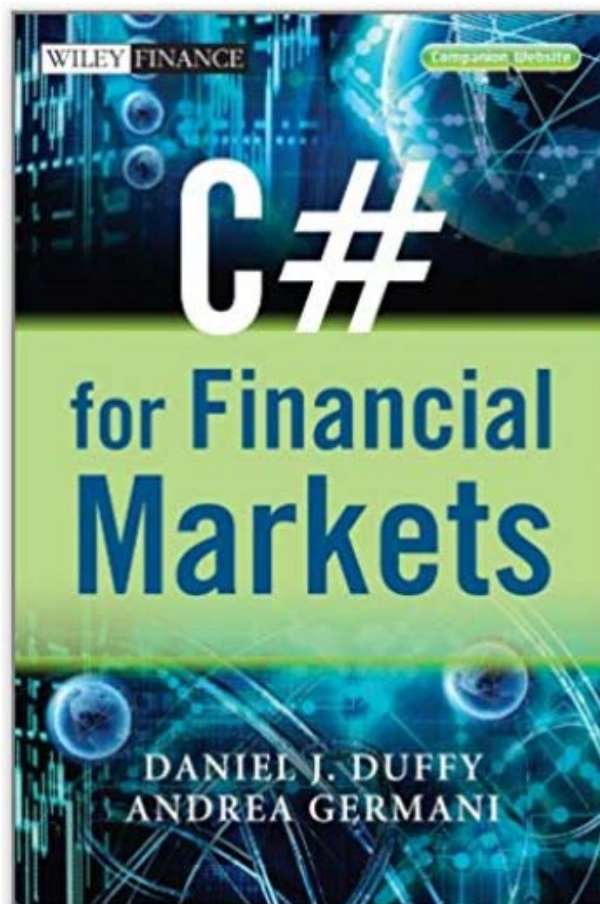


ISBN-13: 978-0470712207

ISBN-10: 0470712201

◆ 8. "C# for Financial Markets.", Daniel Duffy & Andrea Germani.

➤ Duffy 垂幕之作，C#語言少見的財務應用之作。

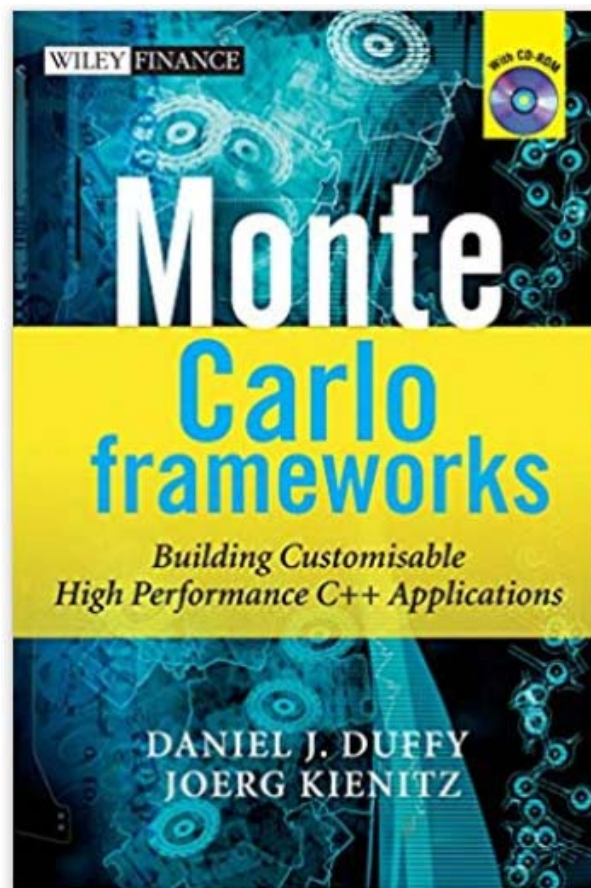


ISBN-13: 978-0470030080

ISBN-10: 0470030089

◆ 9. "Monte Carlo Frameworks.", Daniel Duffy & Jorg Kienitz.

➤ 相當完整的蒙地卡羅法介紹。

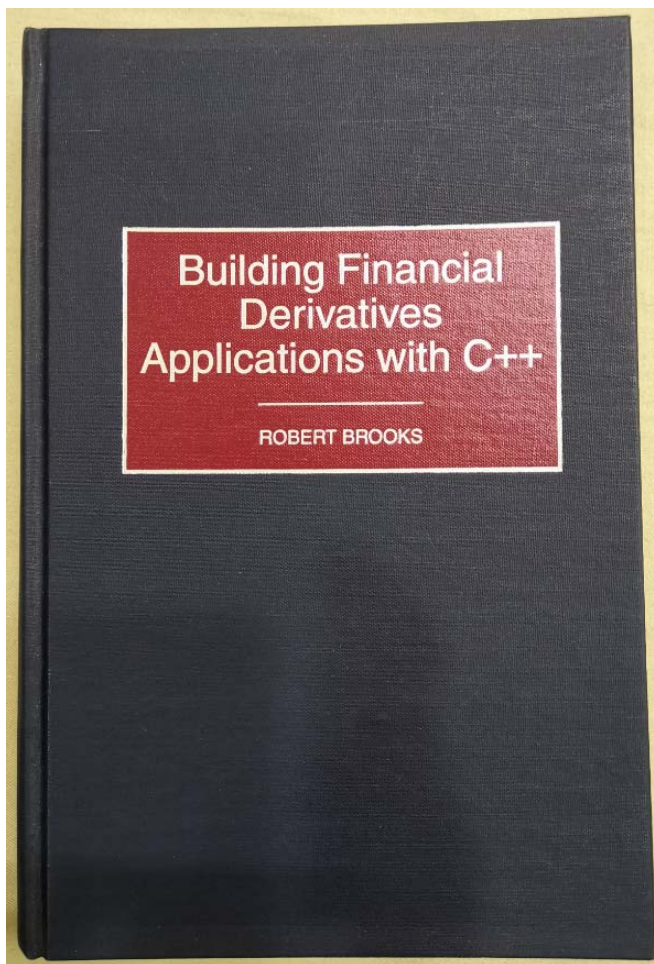


ISBN-13: 978-0470060698

ISBN-10: 0470060697

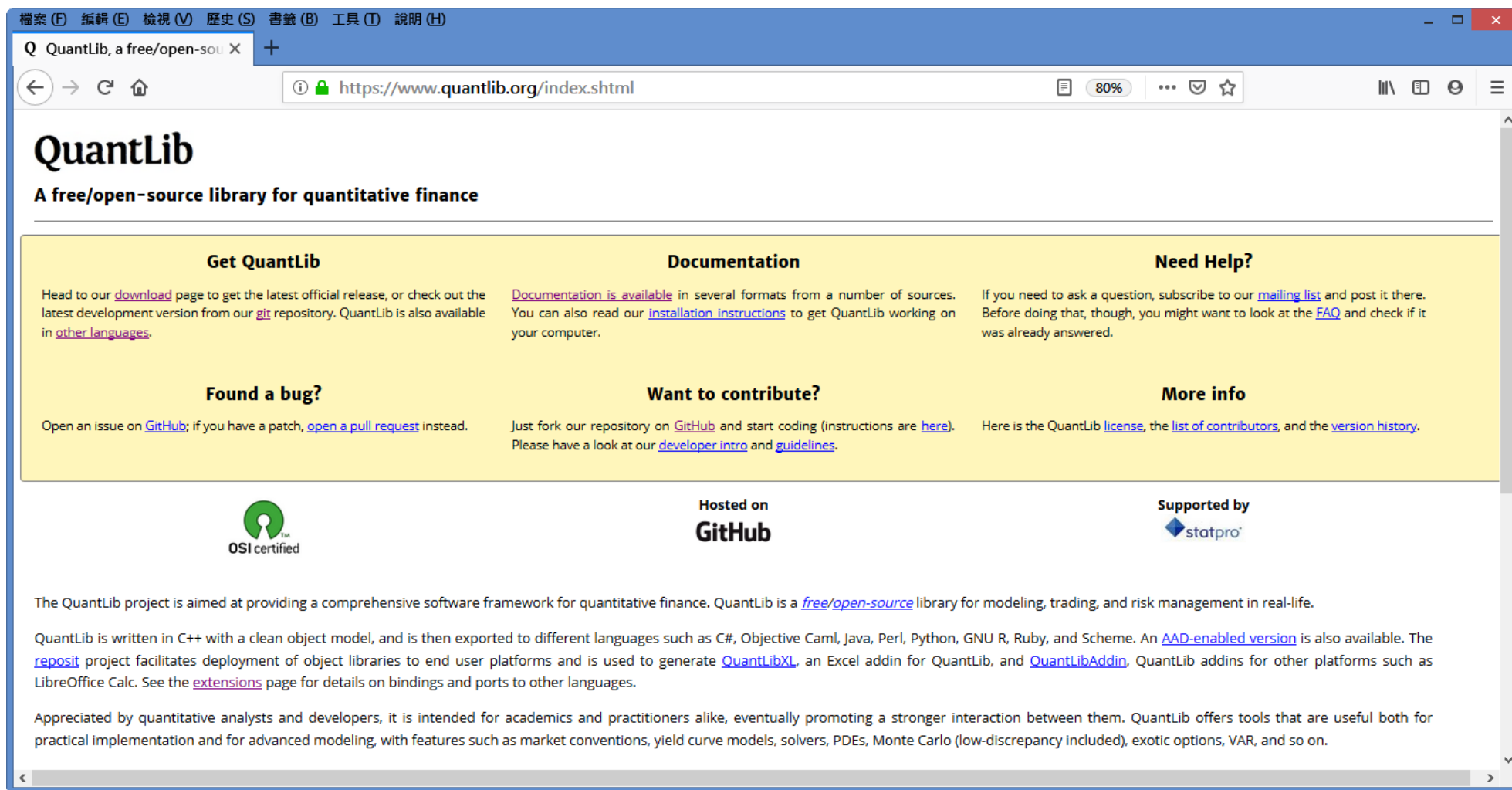
◆ 10. "Building Financial Derivatives: Applications with C++.", Robert Brooks.

- 20 年前在第一份工作時買的第一本財工書籍，遙想當年看到此書，如同開啟一扇窗戶，窺視著歐美資本市場的秘密。



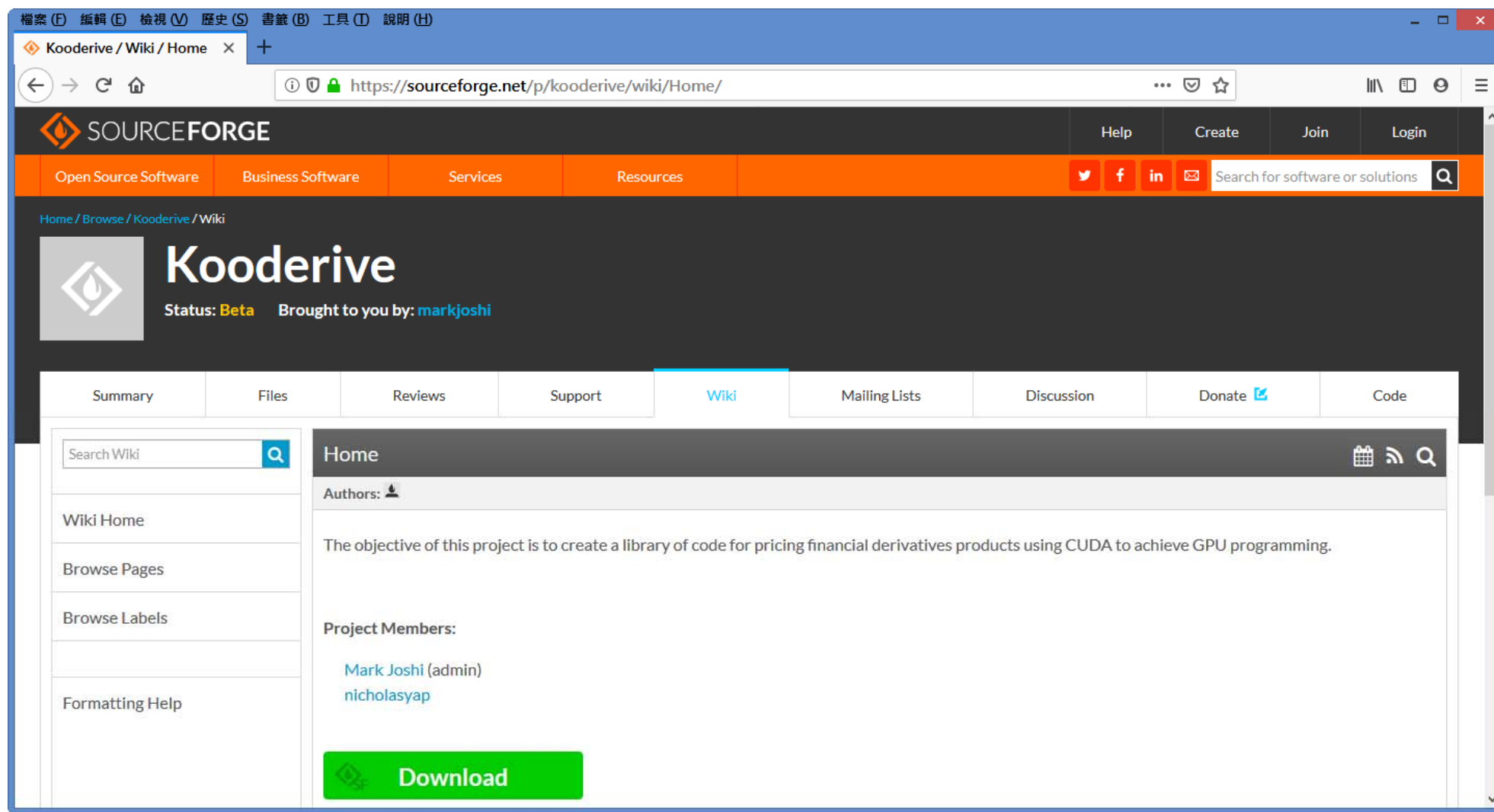
◆ QuantLib : A free/open-source library for quantitative finance.

➤ 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。



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