

金融期货与期权



[金融期货与期权_下载链接1_](#)

著者:施兵超

出版者:三联书店上海分店

出版时间:1996-06

装帧:平装

isbn:9787542609199

本书是作者在广泛参阅国内外最新出版的同类著作、掌握大量第一手资料的基础上，结合中国读者的实际需要及教科书的特点编著而成的。在编著过程中，作者主要作了如下三个方面的尝试：

- 1、在体系上，力求做到循序渐进、由浅入深，以使全书结构严谨合理，既做到各章之间的紧密联系，又避免不必要的重复。
- 2、在内容上，尽量选择新颖、实用，且属于基本原理、基础知识的部分。当然，为兼顾不同层次读者的需要，在某些章节中，也适当加入了一些专业性较强、程序较深的内容。
- 3、在写作方法上，努力做到简明扼要、深入浅出、通俗易懂、详略得当。尤其是在文字表达的“中文化”方面，作了较大的努力，以尽可能避免生硬的直译和简单的拼凑。

需要说明的是，作为一本相对独立的教科书，本书的个别章节可能与其他教科书的相关部分略有重复。

作者介绍:

目录: 目录

前言

上篇 金融期货

第一章 金融期货概述

第一节 金融期货的产生与发展

一、金融期货的定义

二、金融期货的产生

三、金融期货的发展

第二节 金融期货的基本特性

一、金融商品的基本特性

二、金融期货交易的基本特性

第三节 金融期货交易的基本规则

一、金融期货合约的基本要素

二、金融期货的保证金制度

三、金融期货交易的订单

第四节 金融期货市场

一、金融期货市场的基本类型

二、金融期货市场的基本结构

三、金融期货市场的基本功能

四、世界主要金融期货市场简介

第二章 外汇期货

第一节 外汇与汇率

一、外汇的概念

二、汇率及其标价方法

三、决定和影响汇率的基本因素

四、外汇风险及其防范

第二节 外汇期货及其特点

一、外汇期货的概念

二、外汇期货与远期外汇交易的区别和联系

第三节 外汇期货的交易规则

一、外汇期货的报价方式与行情表解读

二、外汇期货的合约规格

第四节 购买力平价说与利率平价说

一、购买力平价说

二、利率平价说

第三章 利率期货

第一节 债务凭证及其价格与收益

一、债务凭证的种类

二、债务凭证的价格与收益

第二节 利率期货的产生与发展

一、利率期货的产生

二、利率期货的发展

三、利率期货的主要种类

第三节 短期利率期货的交易规则

一、国库券期货的交易规则

二、欧洲美元定期存款期货的交易规则

第四节 长期利率期货的交易规则

一、长期国债期货的报价方式与行情表解读

二、长期国债期货的合约规格

三、转换系数与发票金额的确定

四、最便宜可交割债券

第四章 股价指数期货

第一节 股价指数及其编制

一、股价指数的概念

- 二、股价指数的编制方法
- 三、世界著名股价指数简介
- 第二节 股价指数期货的产生与发展
- 一、股票市场的系统性风险与非系统性风险
- 二、股价指数期货的产生
- 三、股价指数期货的发展
- 第三节 股价指数期货的交易规则
- 一、股价指数期货的报价方式
- 二、股价指数期货的合约规格
- 三、股价指数期货的现金结算方式
- 第五章 金融期货的套期保值
- 第一节 金融期货套期保值的基本原理
- 第二节 金融期货套期保值的基本步骤
- 一、金融风险的估计与套期保值目标的确定
- 二、套期保值工具的比较与选择
- 三、套期保值比率的确定
- 四、套期保值策略的制定与实施
- 五、套期保值过程的监控与评价
- 第三节 外汇期货的套期保值
- 一、多头套期保值
- 二、空头套期保值
- 三、交叉套期保值
- 第四节 短期利率期货的套期保值
- 一、国库券期货的套期保值
- 二、欧洲美元期货的套期保值
- 第五节 长期利率期货的套期保值
- 一、转换系数模型
- 二、回归模型
- 三、存续期模型
- 第六节 股价指数期货的套期保值
- 一、股价指数期货的空头套期保值
- 二、股价指数期货的多头套期保值
- 三、贝他系数与股价指数期货的套期保值
- 第六章 金融期货的套利与投机
- 第一节 套利与投机的异同
- 一、套利的定义与性质
- 二、投机的定义与性质
- 三、套利与投机的区别
- 第二节 套利与投机在金融期货交易中的作用
- 一、承担金融风险，为套期保值者转移金融风险提供必备的条件
- 二、平衡金融期货合约的供求，缩小金融期货价格的波动幅度，促进均衡价格的形成
- 三、增加市场流动性，为套期保值者提供交易上的便利
- 第三节 金融期货的套利策略
- 一、合约内价差
- 二、合约间价差
- 三、市场间价差
- 第四节 金融期货的投机策略
- 一、金融期货的多头投机
- 二、金融期货的空头投机
- 三、金融期货投机的风险管理
- 第七章 金融期货价格的分析与预测
- 第一节 金融期货的理论价格及其决定
- 一、金融期货价格与金融现货价格的关系
- 二、持有成本与理论期货价格的决定

三、现货——持有套利与金融期货之理论价格的形成

四、金融期货之理论价格的计算方法

第二节 金融期货价格的基本分析法

一、市场供求原理

二、决定与影响金融期货价格的基本因素

三、政府的财政政策与货币政策

四、对基本分析法的简要评价

第三节 金融期货价格的技术分析法

一、图形分析法

二、统计分析法

三、对技术分析法的简要评价

下篇 金融期权

第八章 金融期权概述

第一节 金融期权的基本概念

一、期权购买者与期权出售者

二、买入期权与卖出期权

三、协定价格

四、期权费

五、欧洲式期权与美国式期权

六、实值、虚值与平价

第二节 金融期权市场及其交易制度

一、金融期权市场的产生与发展

二、金融期权市场的交易制度

三、金融期权的报价方式与行情表解读

第三节 金融期权的主要种类

一、金融期权的分类

二、主要金融期权合约简介

第四节 金融期权交易的基本策略

一、买进看涨期权

二、卖出看涨期权

三、买进看跌期权

四、卖出看跌期权

第五节 金融期权与金融期货的比较

一、权利与义务的对称性不同

二、履约保证不同

三、现金流转不同

四、盈利与亏损的特点不同

五、标的物不同

六、套期保值的作用和效果不同

第九章 金融期权的定价模型

第一节 金融期权价格的构成

一、内在价值

二、时间价值

三、影响期权价格的主要因素

第二节 布莱克—斯科尔斯模型

一、布莱克—斯科尔斯模型的假设条件

二、现货看涨期权的定价模型

三、期货看涨期权的定价模型

四、看跌期权的定价模型

五、布莱克—斯科尔斯模型的应用

第三节 二项式模型

一、一期间模型

二、多期间模型

第四节 金融期权价格的敏感性指标

- 一、Delta (δ)
- 二、Gamma (γ)
- 三、Lambda (λ)
- 四、Theta (θ)
- 五、Rho (ρ)
- 第十章 金融期权的价差交易策略
- 第一节 垂直价差
 - 一、牛市看涨期权价差
 - 二、牛市看跌期权价差
 - 三、熊市看涨期权价差
 - 四、熊市看跌期权价差
- 第二节 蝶状价差
 - 一、多头蝶状价差
 - 二、空头蝶状价差
 - 三、蝶状价差的性质
 - 四、蝶状价差的适用场合及协定价格的选择
- 第三节 比率价差
- 第四节 水平价差
- 第十一章 金融期权的对敲策略与合成策略
- 第一节 同价对敲
 - 一、等量同价对敲
 - 二、不等量同价对敲
- 第二节 异价对敲
 - 一、买进异价对敲
 - 二、卖出异价对敲
- 第三节 合成期货
 - 一、合成买进期货
 - 二、合成卖出期货
 - 三、期权费收支与合成期货的价格
- 第四节 合成期权
 - 一、合成买进看涨期权
 - 二、合成买进看跌期权
 - 三、合成卖出看跌期权
 - 四、合成卖出看涨期权
- 参考书目
 - • • • • ([收起](#))

[金融期货与期权_下载链接1](#)

标签

金融

教科书

投资

经济学

经济

评论

[金融期货与期权 下载链接1](#)

书评

[金融期货与期权 下载链接1](#)