

《期权希腊参数在交易中的应用》

图书基本信息

书名：《期权希腊参数在交易中的应用》

13位ISBN编号：9787504979899

出版时间：2015-9

作者：丹·帕萨雷里（Dan Passarelli）

页数：268

译者：邬雨杉,张志威

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《期权希腊参数在交易中的应用》

内容概要

介绍各种类型的期权组合、期权平价理论和合成期权、波动率交易、高级期权交易有关的注意事项。随着时间的推移，第二版中的图表和例子也做了相应的更新，并且讨论了如何恰当运用期权希腊参数，进而更加精确地定价和交易，同时也提示其他的交易机会。从作者独特的视觉和言简意赅的语言风格中，各个层次的交易者都可以从此书中获得可靠裨益。

《期权希腊参数在交易中的应用》

书籍目录

第一部分期权希腊参数基础

第一章基础知识

期权合约的权利和义务

交易型开放式基金（ETFs）、指数和控股公司存托凭证（HOLDERS）

策略和到期图

第二章Greek原理

价格vs.价值：交易员是如何运用期权定价模型的

Delta

Gamma

Theta

Vega值

Rho

第三章理解波动率

历史波动率

隐含波动率

预期波动率

隐含波动率的方向

计算波动率的数据

波动率偏度

第四章期权特定风险及机遇

平价看涨期权多头

平价看涨期权多头

溢价看涨期权多头

平价看跌期权多头

找到正确的风险

都是围绕波动性

期权和公平交易

第五章波动率卖出策略介绍

潜在盈利

第六章期权平价理论与合成

期权平价理论要点

美式期权

合成的股票

合成股票策略

理论价和利率

一份看涨期权就是一份看跌期权

第七章Rho

希腊参数Rho和利率

Rho和时间

当计划交易时考虑Rho

交易Rho

第八章分红和期权定价

股利的基本要素

股利和期权定价

股利和提前行权

把股利数据输入到定价模型中

第二部分Spreads套利

《期权希腊参数在交易中的应用》

第九章 Vertical Spreads 垂直套利

垂直套利

垂直套利和波动率

信贷套利和债务套利的相互联系性

创建一个盒子

垂直价差

第十章 羽翼式套利

飞鹰式和蝶式期权

起飞

成功秘诀

期权的希腊参数和羽翼式套利

定向蝶式期权

构建交易模型使利益最大化

零售交易商对专业交易商

第十一章 日历套利与对角套利

日历套利

交易波动率期限结构

对角套利

日历套利的优势

第三部分 波动率

第十二章 Delta中性交易，交易隐含波动率

方向中性比方向无关

Delta中性

交易隐含波动率

结论

第十三章 Delta中性交易——交易已实现波动率

Gamma倒卖

艺术与科学

Gamma，Theta和Volatility

Gamma对冲

第十四章 学习波动率图表

9种波动率图

第十五章 跨式期权宽跨式期权

跨式期权多头

跨式期权空头

合成跨式期权

宽跨式期权多头

宽跨式期权空头

第十六章 比率套利与复杂套利

比率套利

做市商怎样管理Delta中性头寸

偏斜交易

当Delta中性不是方向无关时

管理多重风险

第十七章 将希腊参数付诸实践

交易期权希腊参数

选择交易策略

管理交易

HAPI：热切期盼指数

调整

《期权希腊参数在交易中的应用》

精彩短评

1、记住，沉在海底的每一艘船都有一张航海图。

《期权希腊参数在交易中的应用》

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu000.com