

《期货与期权市场导论》

图书基本信息

书名：《期货与期权市场导论》

13位ISBN编号：978730018894X

出版时间：2014-4-1

作者：（加）约翰·C·赫尔

页数：520

译者：郭宁

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

《期货与期权市场导论》

内容概要

《期货与期权市场导论(第7版全球版)》对于具有有限数学知识的读者是十分理想的，它是作者约翰·C·赫尔以自己的《期权、期货和其他衍生产品》华尔街和大学中最畅销的书为基础写成的。本书主要涉及期货、交换市场和期权市场等方面的内容，读者可以根据自身情况侧重学习其中一个或多个方面的知识。本书是投资从业者和投资研究者理想的参考书。

《期货与期权市场导论》

作者简介

约翰·C·赫尔，加拿大多伦多大学教授，Bonharm金融中心主任，国际公认的金融衍生品方面的权威，研究领域包括信用风险、经理股票期权，波动率曲面市场风险以及利率衍生产品。他著有《风险管理与金融机构》、《期权、期货和其他衍生品》和《期货与期权市场导论》等经典著作，其有关金融衍生产品的教材和著作被翻译成多种文字，并在全世界广泛流行。

书籍目录

第1章 绪论

- 1.1 期货合约
- 1.2 期货市场的发展历史
- 1.3 场外交易市场
- 1.4 远期协议
- 1.5 期权
- 1.6 期权市场的发展历史
- 1.7 交易者的类型
- 1.8 套期保值交易者
- 1.9 投机者
- 1.10 套利交易者
- 1.11 危险

第2章 期货市场交易制度

- 2.1 期货头寸的建仓与平仓
- 2.2 期货合约条款
- 2.3 期货价格向现货价格的收敛
- 2.4 保证金账户的操作
- 2.5 场外交易市场
- 2.6 报纸刊登的价格信息
- 2.7 交割
- 2.8 交易者的类型以及交易指令的类型
- 2.9 监管
- 2.10 会计与税收处理
- 2.11 远期协议与期货合约

第3章 使用期货合约的套期保值策略

- 3.1 基本原理
- 3.2 支持与反对套期保值交易的言论
- 3.3 基差风险
- 3.4 交叉套期保值
- 3.5 股票指数期货合约
- 3.6 套期保值头寸的展期

第4章 利率

- 4.1 利率的类型
- 4.2 利率的测算
- 4.3 零息利率
- 4.4 债券定价
- 4.5 计算国债零息利率
- 4.6 远期利率
- 4.7 远期利率协议
- 4.8 利率期限结构理论

第5章 远期价格与期货价格的决定

- 5.1 投资型资产与消费型资产
- 5.2 卖空
- 5.3 假设条件与符号含义
- 5.4 投资型资产的远期价格
- 5.5 收入已知
- 5.6 收益率已知

- 5.7 远期协议的估值
- 5.8 远期价格与期货价格相等吗？
- 5.9 股票指数期货的价格
- 5.10 货币远期协议与货币期货合约
- 5.11 商品期货
- 5.12 持有成本
- 5.13 交割选择
- 5.14 期货价格与预期现货价格
- 第6章 利率期货
 - 6.1 天数计算惯例以及报价惯例
 - 6.2 长期国债期货
 - 6.3 欧洲美元期货
 - 6.4 久期
 - 6.5 基于久期概念的期货套期保值策略
- 第7章 互换
 - 7.1 利率互换的交易机制
 - 7.2 天数计算问题
 - 7.3 确认书
 - 7.4 比较优势观点
 - 7.5 掉期率的本质
 - 7.6 LIBOR/互换零息利率的确定
 - 7.7 利率互换协议的估值
 - 7.8 货币互换
 - 7.9 货币互换产品的估值
 - 7.1 0信用风险
 - 7.1 1其他类型的互换产品
- 第8章 证券化与2007年的次贷危机
 - 8.1 证券化
 - 8.2 美国住房市场
 - 8.3 到底是哪里出错了？
 - 8.4 规避金融危机的再次爆发
- 第9章 期权市场运行机制
 - 9.1 期权的类型
 - 9.2 期权头寸
 - 9.3 期权的标的资产
 - 9.4 股票期权合约的特殊规定
 - 9.5 交易
 - 9.6 佣金
 - 9.7 保证金
 - 9.8 期权清算公司
 - 9.9 监管
 - 9.1 0税收
 - 9.1 1权证、员工股票期权以及可转换债券
 - 9.1 2期权的场外交易市场
- 第10章 股票期权的性质
 - 10.1 影响期权价格的因素
 - 10.2 假设条件与符号指代
 - 10.3 期权价格的上边界与下边界
 - 10.4 看跌期权—看涨期权平价关系

- 10.5 以不支付股息的股票为标的的看涨期权
- 10.6 以不支付股息的股票为标的的看跌期权
- 10.7 股息的影响
- 第11章 期权交易策略
 - 11.1 使用单一期权产品及股票的交易策略
 - 11.2 价差交易策略
 - 11.3 组合期权策略
 - 11.4 其他类型的盈亏曲线
- 第12章 二叉树期权定价理论简介
 - 12.1 单时段二叉树模型与不存在套利机会的假设条件
 - 12.2 风险中性定价
 - 12.3 二时段二叉树模型
 - 12.4 看跌期权的定价
 - 12.5 美式期权
 - 12.6 DELTA
 - 12.7 确定u与d的值
 - 12.8 增加时段的个数
 - 12.9 以其他资产为标的的期权
- 第13章 股票期权的估值：布莱克斯科尔斯默顿模型
 - 13.1 有关未来股票价格波动轨迹的假设条件
 - 13.2 预期收益
 - 13.3 波动率
 - 13.4 根据历史数据估算波动率
 - 13.5 布莱克斯科尔斯默顿模型的假设条件
 - 13.6 无套利机会估值法的关键所在
 - 13.7 布莱克斯科尔斯默顿期权定价公式
 - 13.8 风险中性估值法
 - 13.9 隐含波动率
 - 13.1 0股息
 - 13.1 1评估员工股票期权的价值
- 第14章 发展中国家的衍生品市场
 - 14.1 中国国内的衍生品市场
 - 14.2 印度国内的衍生品市场
 - 14.3 其他发展中国家
- 第15章 股票指数期权与货币期权
 - 15.1 股票指数期权
 - 15.2 货币期权
 - 15.3 标的为股息收益率已知的股票的期权产品
 - 15.4 欧式股票指数期权的估值
 - 15.5 欧式货币期权的估值
 - 15.6 美式期权
- 第16章 期货期权
 - 16.1 期货期权的本质
 - 16.2 期货期权广受欢迎的原因
 - 16.3 欧式现货期权与期货期权
 - 16.4 看跌期权—看涨期权平价关系式
 - 16.5 期货期权的价格边界
 - 16.6 使用二叉树模型评估期货期权的价值
 - 16.7 将期货价格当作收益率已知的资产来处理

- 16.8 使用布莱克模型来评估期货期权的价值
- 16.9 使用布莱克模型而非布莱克斯科尔斯默顿模型来进行估值
- 16.1 0美式期货期权与美式现货期权
- 16.1 1期货式期权
- 第17章 希腊字母
 - 17.1 示例
 - 17.2 无保护头寸与有保护头寸
 - 17.3 止损策略
 - 17.4 delta套期保值策略
 - 17.5 theta
 - 17.6 gamma
 - 17.7 delta、theta与gamma之间的关系
 - 17.8 vega
 - 17.9 rho
 - 17.1 0对冲交易的现实情况
 - 17.1 1虚拟情景分析
 - 17.1 2公式的拓展
 - 17.1 3采用合成方式创建期权
 - 17.1 4股票市场的波动率
- 第18章 二叉树模型的实际运用
 - 18.1 适用于标的为不支付股息的股票的美式期权的二叉树估值模型
 - 18.2 使用二叉树模型评估指数期权、货币期权以及期货期权的价值
 - 18.3 标的为支付股息的股票的期权如何使用二叉树模型
 - 18.4 基本二叉树估值法的拓展
 - 18.5 构建二叉树图的其他方法
 - 18.6 蒙特卡洛模拟法
- 第19章 波动率微笑曲线
 - 19.1 外汇期权
 - 19.2 股票期权
 - 19.3 波动率期限结构与波动率曲面
 - 19.4 预期未来价格将会出现一次大幅变化
- 第20章 在险价值
 - 20.1 在险价值指标
 - 20.2 历史模拟法
 - 20.3 建模法
 - 20.4 线性模型的一般化形式
 - 20.5 二次模型
 - 20.6 估算波动率与相关系数
 - 20.7 两种计算方法的比较
 - 20.8 压力测试与后向测试
- 第21章 利率期权
 - 21.1 交易所内交易的利率期权产品
 - 21.2 内嵌的债券期权
 - 21.3 布莱克模型
 - 21.4 欧式债券期权
 - 21.5 利率上限
 - 21.6 欧式互换期权
 - 21.7 期限结构模型
- 第22章 奇异期权与其他非标准期权

- 22.1 奇异期权
- 22.2 机构抵押贷款担保证券
- 22.3 非标准化的互换协议
- 第23章 信用衍生品
 - 23.1 信用违约互换
 - 23.2 信用违约互换价差的计算
 - 23.3 总收益互换
 - 23.4 信用违约互换远期与信用违约互换期权
 - 23.5 担保债务证券
- 第24章 天气、能源以及保险衍生品
 - 24.1 天气衍生品
 - 24.2 能源衍生品
 - 24.3 保险衍生品
- 第25章 衍生品交易带来的灾难与教训
 - 25.1 所有衍生品的使用者应汲取的教训
 - 25.2 金融机构应汲取的教训
 - 25.3 非金融机构应汲取的教训
- 小测验答案
- 词汇表
- 译后记

精彩短评

1、买了先

《期货与期权市场导论》

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