

# 《波动率指数衍生品交易》

## 图书基本信息

书名：《波动率指数衍生品交易》

13位ISBN编号：9787564215194

10位ISBN编号：7564215194

出版时间：2013-8-1

出版社：上海财经大学出版社

作者：罗素·罗兹 (Russell Rhoads)

页数：239

译者：周光起

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](http://www.tushu000.com)

# 《波动率指数衍生品交易》

## 内容概要

《波动率指数衍生品交易:运用波动率指数期货、期权和交易所交易票据进行交易与对冲的策略(引进版)》主要讲述了,尽管芝加哥期权交易所波动率指数(泛用符号VIX)常常被称为“恐惧指数”,它比之股市的恐惧指数含义更丰富。《波动率指数衍生品交易:运用波动率指数期货、期权和交易所交易票据进行交易与对冲的策略(引进版)》是一本可信赖的著作,叙述生动、信息量大,它为读者提供了充实的知识,内容涉及隐含波动率、波动率指数、用波动率指数进行市场分析以及直接以波动率进行交易的方法。通过逐页阅读,你将会熟悉许多时下可供的与波动率相关的指数和产品——从标准普尔500隐含相关性指数(VTY)和芝加哥期权交易所原油波动率指数到波动率指数期货、期权和交易所交易票据。许多基于隐含波动率的衍生品合约都有其独特的特征,对此,全书都有涉及。在书中,罗兹不失时机地重点列出了与波动率相关的指数和产品的不同使用方法。从波动率指数期权和期货的日历价差交易到波动率指数的鹰展式价差交易和蝶飞式价差交易,他都为读者提供了有价值的考察方式,从而详尽地讨论了波动率指数衍生品的交易方法。作为资产类别和交易工具的波动率是股市上持续迅速增长的领域。把《波动率指数衍生品交易:运用波动率指数期货、期权和交易所交易票据进行交易与对冲的策略(引进版)》作为指南,你将很快找到一系列的与波动率指数相关的用法,学会如何在日常的投资活动中使用新的预测方法和交易技巧,并获得利润。

## 书籍目录

总序

序言

致谢

第一章隐含波动率的基础知识

历史波动率与远期波动率之比较

“看跌—看涨期权平价”原理

价格变动的估计

期权估价：定价计算器和其他工具

基于供求关系的波动

对期权价格的影响

隐含波动率和波动率指数

第二章关于波动率指数

波动率指数的历史

波动率指数的计算

波动率指数和“看跌—看涨期权平价”原理

波动率指数和市场变动

股票市场波动率指数

第三章波动率指数期货

新产品的稳定增长

合约内容

微型波动率指数期货

波动率指数期货和指数间的定价关系

各种期货之间的关系

波动率指数期货数据

第四章波动率指数期权

合约内容

与波动率指数的关系

与波动率指数期货的关系

波动率指数双值型期权

第五章芝加哥期权交易所波动率指数期货的每周期权

合约内容

每周期权和指数期权

每周期权策略

第六章波动率相关的交易所交易票据

何谓交易所交易票据

电子通道标准普尔500波动率指数短期期货交易所交易票据

电子通道标准普尔500波动率指数中期期货交易所交易票据

电子通道标准普尔500波动率指数短期期货交易所交易票据和电子通道标准

普尔500波动率指数中期期货交易所交易票据表现的比较

巴克莱银行交易所交易票据+反向型标准普尔500波动率指数的短期期货交

易所交易票据

巴克莱银行交易所交易票据+标准普尔目标报酬型交易所交易票据

标准普尔500波动率指数期货源泉型交易所交易基金

第七章各种股票波动率和策略指数

芝加哥期权交易所标准普尔500三个月期波动率指数

波动率指数溢价策略指数

上限型波动率指数溢价策略指数

# 《波动率指数衍生品交易》

标准普尔500VARB—X策略基准  
标准普尔500隐含相关性指数  
第八章关于不同资产的波动率指数  
芝加哥期权交易所黄金波动率指数  
芝加哥期权交易所原油波动率指数  
芝加哥期权交易所欧元波动率指数  
芝加哥期权交易所纽约商品交易所原油波动率指数  
芝加哥期权交易所纽约商品交易所黄金波动率指数  
芝加哥期权交易所芝加哥商品期货交易所谷物波动率指数  
外汇实际波动率指数  
第九章作为股票市场指标的波动率指数  
波动率指数与标准普尔500指数的反向关系  
作为指标的波动率指数  
作为指标的波动率指数期货  
改善型波动率指数期货合约  
波动率指数期货与波动率指数的组合  
波动率指数与黄金价格指标  
波动率指数期权“看跌一看涨期权比率”  
第十章运用波动率指数衍生品对冲  
运用波动率指数期权对冲  
运用波动率指数期货对冲  
马萨诸塞州立大学的研究  
第十一章运用波动率指数衍生品进行投机  
波动率指数期货交易  
波动率指数期权交易  
波动率指数交易所交易票据交易  
各种波动率指数交易工具之间的比较  
第十二章波动率指数期货的日历价差交易  
波动率指数期货价格之间的比较  
日历价差交易的机制  
数据形态  
交易管理  
其他参数  
第十三章波动率指数期权的日历价差交易  
波动率指数期权定价  
看跌期权的日历价差交易  
看涨期权的日历价差交易  
看跌期权的对角线价差交易  
看涨期权的对角线价差交易  
第十四章波动率指数期权和期货的日历价差交易  
期权和期货的比较  
日历价差交易实例  
第十五章波动率指数期权的垂直价差交易  
垂直价差交易实例  
第十六章波动率指数期权的鹰展式价差交易和蝶飞式价差交易  
何谓鹰展式价差交易  
波动率指数期权的鹰展式价差交易  
何谓蝶飞式价差交易  
波动率指数期权的蝶飞式价差交易

# 《波动率指数衍生品交易》

文摘

# 《波动率指数衍生品交易》

## 精彩短评

1、美股已经高位横盘一个半月了，周五耶伦再不表明点态度，交易员都不用上班了...

# 《波动率指数衍生品交易》

## 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](http://www.tushu000.com)