

《期权交易——核心策略与技巧解析（ 》

图书基本信息

书名：《期权交易——核心策略与技巧解析（修订版）》

13位ISBN编号：9787121280590

出版时间：2016-3

页数：336

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

《期权交易——核心策略与技巧解析（ ）》

内容概要

《期权交易——核心策略与技巧解析（修订版）》是一本深入浅出地介绍期权策略的参考书，作者力求把概念讲清楚，把策略说透彻，不罗列模型，不堆砌公式，以指导实战为最终目的，技巧解读入木三分。《期权交易——核心策略与技巧解析（修订版）》内容包括基本策略、价差策略、牛市策略、熊市策略、大波动策略、小波动策略、套利策略、套期保值策略、波动率交易等。对于每一种策略，通过举例分析了策略的适用场景、收益风险特征、盈亏平衡点、优点与缺点、希腊字母特征、执行过程的注意事项以及与其他策略的对比和转换，策略呈现全面细致。另外，《期权交易——核心策略与技巧解析（修订版）》还附有期权策略选择框架及常用策略简表，可帮助读者形成自己的期权交易系统。

《期权交易——核心策略与技巧解析（修订版）》适合从零基础开始学习期权的投资者，也适合有一定期权基础，并想全面提高期权交易能力的人士翻阅。

《期权交易——核心策略与技巧解析（）》

作者简介

王勇，农产品期权专家，期权千人会联合发起人，现任宏源期货高级分析师。王勇先生有多年期货投资经验，在CCTV、中国证券报、期货日报等各大媒体发表评论近百篇，2011年获“大商所十大研发团队”比赛农产品组第一名。王勇先生发起成立的对冲基金工社是较有影响力的行业组织之一。

书籍目录

第1章 初识期权 1

- 1.1 什么是期权 1
- 1.2 期权合约的构成要素 2
- 1.3 期权的分类 3
- 1.4 期权为何如此迷人 3
- 1.5 期权交易与期货、权证交易的对比 5
- 1.6 期权价格的构成 6
- 1.7 期权价格的影响因素 7
- 1.8 交易期权就像开飞机 10

第2章 基本策略积木 12

- 2.1 买入与卖出标的资产 (Long/Short Underlying Asset) 12
 - 2.2 买入看涨期权 (Long Call) 14
 - 2.3 裸卖出看涨期权 (NakedShort Call) 18
 - 2.4 买入看跌期权 (Long Put) 23
 - 2.5 裸卖出看跌期权 (NakedShort Put) 29
 - 2.6 合成头寸 (SyntheticPositions) 34
- 参考文献41

第3章 期权价差策略42

- 3.1 期权价差概述 (OptionsSpread) 42
 - 3.2 垂直价差 (VerticalSpreads) 46
 - 3.3 时间价差 (Time Spreads) 48
 - 3.4 对角价差 (DiagonalSpreads) 51
 - 3.5 借方价差与贷方价差 (Debit/Credit Spreads) 51
 - 3.6 比率价差 (Ratio Spreads) 58
- 参考文献 61

第4章 牛市交易策略 62

- 4.1 买入看涨期权 (LongCall) 63
- 4.2 裸卖出看跌期权 (NakedShort Put) 63
- 4.3 牛市看涨期权价差 (BullCall Spread) 63
- 4.4 牛市看跌期权价差 (BullPut Spread) 68
- 4.5 深度实值牛市看跌期权价差 (Deep ITM BullPut Spread) 72
- 4.6 卖出虚值看跌期权 (WritingOut Of The MoneyPutOptions) 77
- 4.7 卖出现金担保看跌期权 (CashSecured Put) 80
- 4.8 看涨期权比率价差 (Bull Ratio Spread) 83
- 4.9 空头看涨期权比率价差 (Short Bull Ratio Spread) 89
- 4.10 牛市看涨期权梯形价差 (Long CallLadder Spread) 94
- 4.11 合成“类标的资产” (Risk Reversal) 99

第5章 熊市交易策略106

- 5.1 买入看跌期权 (Long Put) 107
- 5.2 裸卖出看涨期权 (NakedShort Call) 107
- 5.3 熊市看跌期权价差 (BearPut Spread) 107
- 5.4 熊市看涨期权价差 (BearCall Spread) 111
- 5.5 深度实值熊市看涨期权价差 (Deep ITM BearCall Spread) 116
- 5.6 看跌期权比率价差 (BearRatio Spread) 120
- 5.7 空头看跌期权比率价差 (Short BearRatio Spread) 126
- 5.8 熊市看跌期权梯形价差 (Bear PutLadder Spread) 130

第6章 大波动交易策略136

- 6.1 大波动策略简介 (VolatileOptions Strategies) 136
- 6.2 买入跨式期权 (LongStraddle) 138
- 6.3 买入条形跨式 (StripStraddle) 142
- 6.4 买入带形跨式 (StrapStraddle) 146
- 6.5 买入宽跨式 (LongStrangle) 150
- 6.6 买入带形宽跨式 (Strap Strangle) 154
- 6.7 买入条形宽跨式 (Strip Strangle) 158
- 6.8 买入飞碟式期权 (Long Gut) 162
- 6.9 卖出看涨期权水平价差 (Short Horizontal CalendarCallSpread) 166
- 6.10 卖出看涨期权对角价差 (Short Diagonal CalendarCall Spread) 169
- 6.11 卖出看跌期权水平价差 (Short Horizontal CalendarPutSpread) 172
- 6.12 卖出看跌期权对角价差 (Short Diagonal CalendarPutSpread) 175
- 6.13 卖出蝶式价差 (ShortButterfly Spread) 178
- 6.14 卖出秃鹰式价差 (ShortCondor Spread) 181
- 6.15 卖出信天翁价差 (ShortAlbatross Spread) 185
- 6.16 反向铁蝶式价差 (ReverseIron Butterfly Spread) 187
- 6.17 反向铁鹰式价差 (ReverseIron Condor Spread) 190
- 6.18 反向铁信天翁价差 (ReverseIron Albatross Spread) 193
- 第7章 小波动交易策略 196
 - 7.1 卖出跨式 (ShortStraddle) 196
 - 7.2 卖出宽跨式 (ShortStrangle) 200
 - 7.3 卖出飞碟式 (Short Gut) 204
 - 7.4 卖出条形跨式 (ShortStrip Straddle) 208
 - 7.5 卖出带形跨式 (ShortStrap Straddle) 212
 - 7.6 卖出条形宽跨式 (ShortStrip Strangle) 216
 - 7.7 卖出带形宽跨式 (ShortStrap Strangle) 220
 - 7.8 看涨期权水平价差 (Horizontal CalendarCall Spread) 224
 - 7.9 看涨期权对角价差 (DiagonalCalendar Call Spread) 226
 - 7.10 看跌期权水平价差 (Horizontal CalendarPut Spread) 229
 - 7.11 看跌期权对角价差 (DiagonalCalendar Put Spread) 231
 - 7.12 蝶式价差 (ButterflySpread) 233
 - 7.13 秃鹰式价差 (CondorSpread) 237
 - 7.14 信天翁式价差 (AlbatrossSpread) 241
 - 7.15 铁蝶式价差 (IronButterfly Spread) 244
 - 7.16 铁鹰式价差 (IronCondor Spread) 247
 - 7.17 铁信天翁价差 (LongIron Albatross Spread) 252
 - 7.18 看涨期权折翅蝶式价差 (Call Broken WingButterfly Spread) 254
 - 7.19 看跌期权折翅蝶式价差 (Put Broken WingButterfly Spread) 258
 - 7.20 看涨期权折翅秃鹰式价差 (Call Broken WingCondor Spread) 260
 - 7.21 看跌期权折翅秃鹰式价差 (Put Broken WingCondor Spread) 264
- 第8章 期权套利策略 267
 - 8.1 从单边交易到对冲 267
 - 8.2 期权的套利机会 268
 - 8.3 买卖权平价关系 269
 - 8.4 执行价格套利 272
 - 8.5 转换套利与反转套利 (Conversion / ReversalArbitrage) 274
 - 8.6 箱式套利 (Box Spread) 278
- 第9章 期权套期保值策略 281
 - 9.1 买入保护性看跌期权 (Protective Puts) 281

9.2 配对看跌期权 (Married Puts)	283
9.3 信托看涨期权 (Fiduciary Calls)	286
9.4 卖出持保看涨期权 (Covered Call)	289
9.5 卖出持保深度实值看涨期权 (Deep In The Money Covered Call)	294
9.6 领子期权	298
第10章 波动率交易	302
10.1 波动率概述	302
10.2 隐含波动率	305
10.3 用波动率进行估值	307
10.4 波动率与期权策略的选择	309
10.5 波动率倾斜	312
参考文献	316
附录A 常见期权策略简表	317
附录B 波动率交易策略的特征	321
附录C 选择期权策略的思路框架	322

《期权交易——核心策略与技巧解析（》

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