

《期权实战一本通》

图书基本信息

书名：《期权实战一本通》

13位ISBN编号：9787111442950

10位ISBN编号：7111442954

出版时间：2013-10

出版社：机械工业出版社

作者：张嘉成,周博

页数：292

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

《期权实战一本通》

内容概要

期权对中国而言属于新的金融衍生工具，几乎所有投资者都没有实际操作经验，同时相关知识较为艰涩难懂，本书期望以务实的思路，贴近实战的角度，让投资者先从应用的方式入门，逐步认识工具特性，逐步累积堆迭知识，搭配实际案例，协助投资者深刻地理解期权功能，了解期权适用时机、套期保值、套利操作以及各种交易策略的相关用法。期望投资者能借由此书的引导，找到一个比较有效率的期权学习路径，顺利在实盘交易中实践，并取得一定的成果。

作者简介

张嘉成

永安期货金融机构业务总部总监。主要研究方向为股指期货与金融期货、期权、程序化交易。张先生1998年进入期货行业，2011年加入中国期货市场，之前主要任职于台湾几家知名期货公司，担任机构法人、投资研究、顾问咨询部门负责人，接触高端客户经验相对丰富，对于操盘人养成、程序化建设、期权策略与期货顾问等领域具有相当的功力。累计为从业人员进行专业培训的课时超过1400小时，对于各种主题、各种规模、各种方式的培训与演讲均具有丰富的经验。著有《第一次投资台指选择权就上手》、《第一次交易选择权就上手》。

周博

永安期货北京研究院金融期货部部长，研究方向为期权研究、金融工程研究、套保套利研究、国债研究、数据库开发。毕业于英国Loughborough大学，获随机数学博士。在2012年郑商所期权合作会员期权专题研究中，周博主持的《商品期货期权做市商风险管理研究》课题荣获一等奖。2012年，公司成功入围中金所会员期权业务准备联合研究计划承接机构，完成的联合研究计划荣获一等奖。

书籍目录

编委会

推荐序（中国金融期货交易所 胡政）

序言

引导篇 迎接中国期权时代，你准备好了吗

第一章 迎接中国期权元年 / 2

第一节 期权于中国期货市场的重要性 / 2

第二节 期权在日常生活中的应用 / 3

第三节 期权交易的重要性与必要性 / 5

第二章 期权的历史回顾与未来 / 7

第一节 期权的发展历史 / 7

第二节 全球期权成交状况 / 10

第三节 中国期权准备状况 / 20

第四节 中国期权发展的愿景 / 22

知识篇 认识期权的必要知识

第三章 认识期权合约 / 26

第一节 商品期货期权合约解说 / 26

第二节 金融期权合约解说 / 34

第三节 期权合约种类说明 / 39

第四节 三种状态合约图解 / 43

第四章 认识期权价格——权利金 / 45

第一节 权利金的组成 / 45

第二节 影响期权价格的因素 / 51

第三节 敏感性参数解说 / 54

第五章 期权的定价 / 59

第一节 看涨期权与看跌期权的平价理论 / 59

第二节 看涨期权与看跌期权的上下界 / 62

第三节 定价模型介绍 / 65

第四节 定价模型的应用 / 70

观念篇 期权重要观念

第六章 期权的基本操作法 / 76

第一节 买入看涨期权 / 76

第二节 卖出看涨期权 / 78

第三节 买入看跌期权 / 79

第四节 卖出看跌期权 / 81

第七章 买方与卖方的观念 / 84

第一节 买方代表的意义 / 84

第二节 卖方代表的意义 / 85

第三节 买方与卖方的优劣比较 / 86

第八章 期权的功能 / 89

第一节 风险管理工具 / 89

第二节 套利工具 / 92

第三节 投机操作工具 / 100

应用篇 期权的套期保值

第九章 使用期权套期保值的观念 / 108

第一节 套期保值的基本观念 / 108

第二节 交割的套期保值观念 / 111

第三节 不交割的套期保值观念 / 111

- 第十章 商品(实体)资产的套期保值 / 113
 - 第一节 商品的风险来源 / 113
 - 第二节 产业上下游分别的套期保值需求 / 118
 - 第三节 套期保值流程与步骤 / 120
 - 第四节 套期保值案例分析 / 123
- 第十一章 金融(虚拟)资产的套期保值 / 131
 - 第一节 各种机构客户的风险敞口日趋增加 / 131
 - 第二节 期权套保特征与主要策略介绍 / 133
 - 第三节 套期保值案例分析 / 145
- 操作篇 期权的投机操作
- 第十二章 期权投机操作的决策流程 / 156
 - 第一节 期权投机操作的基本意义 / 156
 - 第二节 投机操作决策流程图 / 158
 - 第三节 投机操作步骤解说 / 159
 - 第四节 方向的评估 / 162
 - 第五节 速度的评估 / 163
- 第十三章 执行价格的选择与权利金的衡量 / 172
 - 第一节 三种状态的合约 / 172
 - 第二节 几个执行价格的选择 / 173
 - 第三节 历史波动率与隐含波动率的思考 / 175
 - 第四节 时间价值的思考 / 179
- 第十四章 期权的特殊指标 / 181
 - 第一节 期权未平仓量的意义 / 181
 - 第二节 总未平仓量与个别未平仓量的观察 / 182
 - 第三节 成交量之卖权/买权比 / 185
 - 第四节 未平仓量之卖权/买权比 / 186
- 进阶篇 期权的进阶策略
- 第十五章 期权复式策略 / 190
 - 第一节 风险有限收益无限的交易策略 / 190
 - 第二节 风险无限收益有限的交易策略 / 192
 - 第三节 风险有限收益有限的交易策略 / 194
 - 第四节 保护式看涨期权与掩护式看跌期权 / 200
 - 第五节 多部位组合策略 / 202
- 第十六章 做市商策略与运作介绍 / 209
 - 第一节 套利策略 / 209
 - 第二节 价格错估的监控策略 / 223
 - 第三节 波动率交易 / 224
 - 第四节 做市商的一天 / 230
- 风险篇 期权的风险管理
- 第十七章 期权的风险管理方法 / 236
 - 第一节 Delta风险值与Delta中性 / 236
 - 第二节 Gamma、Theta的管理 / 238
 - 第三节 敏感性参数中性综合管理 / 241
 - 第四节 VaR与情景分析 / 244
- 备战篇 面对期权, 你该准备什么
- 第十八章 各种身份的准备工作的准备 / 250
 - 第一节 期货商的准备 / 250
 - 第二节 产业客户的准备 / 254
 - 第三节 金融机构的准备 / 255

第四节 资产管理单位的准备 / 257

第五节 一般投资人的准备 / 259

第六节 研究员的准备 / 261

附录 名词解释 / 262

参考文献 / 268

后记 / 269

《期权实战一本通》

精彩短评

1、当敝司还在为期权的人员配备犹豫时，行业中的领军者已经把这么好的教材编出来了.....

《期权实战一本通》

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