

<<期权>>

图书基本信息

书名：<<期权>>

13位ISBN编号：9787500594970

10位ISBN编号：7500594976

出版时间：2007-1

出版时间：中国财政经济出版社

作者：傅德伟,孙培源,刘英华 编著

页数：288

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：<http://www.tushu007.com>

<<期权>>

内容概要

长期以来，深交所对包括期权产品在内的股权类衍生品进行了大量研究和业务准备工作，本书力图反映我们在期权研究上的部分成果。

这本书的主要目的是从应用和监管层面，给读者一个对期权的总体了解。

尽管我们是以股票和股指期货为原型来进行撰写，但因为书中的绝大部分内容同样试用于外汇、利率等期权，因此，我们并没有特别强调期权的标的。

此外，需要特别指出的是，这本书并不是一本教科书，大部分章节是我们研究和思索的结果，因此，全书的结构安排并不强调逻辑性，体例处理上也比较灵活。

全书分为三篇，第一篇是基础篇。

这一部分主要是使读者对衍生品的总体状况和期权基础知识有所了解，力图突出近年来衍生品市场发展的特点和趋势，证券交易所发展期权的必要性、可行性和紧迫性。

<<期权>>

作者简介

傅德伟，毕业于加拿大渥太华大学，获工商管理硕士学位（MBA），持有加拿大衍生品资格证书（DFC）和证券资格证书（CSC）。

曾在芝加哥期权交易所（CBOE）、期权结算公司（OCC）、芝加哥商业交易所（CME）、证监会国际组织（IOSCO）接受系统培训。

1992年加入深圳证券交易所，历任结算部、监察部、策划部、国际部总监、副总监。

发表学术论文多篇。

现任深圳证券交易所衍生品工作小组副组长，负责期权、期货等衍生产品研发。

<<期权>>

书籍目录

导言上篇 基础篇 第1章 金融衍生品概述 1.1 衍生品的主要类型 1.2 金融衍生品的功能和特点 1.3 交易所金融衍生品发展的趋势和特点 1.4 金融衍生品是证券交易所最重要的创新产品之一 1.5 金融衍生品已经成为证券交易所最重要的业务之一 1.6 股票和股指期货的发展状况 第2章 期权基础 2.1 期权的基本要素 2.2 期权的分类 2.3 期权的到期日价值 2.4 看涨和看遗期权平价 2.5 布莱克 - 斯科尔斯期权定价公式中篇 应用篇 第3章 期权风险参数 3.1 Delta 3.2 Gamma 3.3 Theta 3.4 Vega 3.5 Rho 3.6 波动率 第4章 期权基本交易策略 4.1 期权交易策略的相关概念 4.2 投资单个股票期权 4.3 投资单个股票期权与其标的股票的组合 第5章 期权组合交易策略 5.1 期权的合成 5.2 期权的扩展 5.3 比例扩展组合 5.4 期权与标的股票、债券的组合 5.5 交易策略的选择 第6章 期权与结构化产品 6.1 结构化产品概述 6.2 结构化产品详解 6.3 结构化产品的几个相关问题 6.4 结构化产品在中国的发展与展望 第7章 期权与金融市场效率 7.1 期权与信息效率 7.2 衍生品与现货的领先落后关系 7.3 期权与社会福利 7.4 股票期权上市对股票市场的影响下篇 监管篇 第8章 衍生品市场监管的目标和原则 8.1 衍生品市场监管的目标 8.2 衍生品市场的监管原则 8.3 我国金融衍生品市场监管目标和基本要求 第9章 政府监管 9.1 衍生品市场法律法规 9.2 衍生品市场的政府监管 第10章 交易所监管 10.1 交易监管 10.2 结算监管 10.3 风险控制监管 第11章 行业自律组织监管 11.1 行业自律体系的内涵 11.2 行业自律组织的典范——美国全国期货公会 (NFA) 11.3 NFA与美国商品期货委员会 (CFTC) 和交易所的关系 11.4 中国和美国行业自律组织比较 11.5 英国和日本的行业自律组织附录 金融衍生品术语参考文献后记

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:<http://www.tushu007.com>