

<<利率期货与期权>>

图书基本信息

书名：<<利率期货与期权>>

13位ISBN编号：9787309058680

10位ISBN编号：7309058682

出版时间：2008-1

出版时间：复旦大学

作者：卢文莹

页数：147

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>

<<利率期货与期权>>

内容概要

本书系统介绍了利率（国债）期货和期权产品及其国际经验，分析了两者在我国发展的必要性与可行性，并探讨其在中国可能采取的合约形式。

全书主要介绍利率期货与期权产品的特点、产生与发展；利率期货与期权产品的原理与交易策略；利率期货与期权产品的风险及其管理；世界主要利率期货与期权市场；我国利率期货的历史与经验；利率衍生产品在我国发展的必要性与可行性。

充分了解利率衍生产品的特点、国际经验，对于更好地发展中国证券市场具有重大意义。

<<利率期货与期权>>

作者简介

卢文莹，复旦大学经济学博士、高级经济师。

现任上海证券交易所研究中心高级研究员、上海市高级专家、上海市金融工作委员会专业带头人。

历任：香港招商局金融集团助理总经理兼中国事业部总经理，同时出任招商局集团多间公司董事，其中包括香港友联银行中国业务管理公司执行董事、中国基金管理有限公司董事、国通证券责任有限公司董事、雅宏国际有限公司董事等职务；

招商银行上海分行国际业务部高级经济师；

交通银行—上海新世纪金融租赁有限公司总经理办公室主任；

上海国泰证券公司证券分析师。

参与并主持过多项大型的跨国和国内并购案。

如香港招商局金融集团的组建；起草香港招商局集团公路和基建上市方案；主持审议了招商银行和国通证券公司扩股方案；参与了香港友联银行与中国工商银行的收购兼并、票据的发行与资产管理工作；招商局中国基金管理公司的管理和项目的审定工作，出版专著4部和主编专业书籍10余部，发表论文70余篇等等。

<<利率期货与期权>>

书籍目录

导言1 利率期货与利率期权概述 1.1 利率期货概述 1.2 利率期权概述2 利率期货和期权合同的定价与交易策略 2.1 利率期货的定价原理 2.2 利率期权的定价原理 2.3 国债期货的交易策略 2.4 利率期权的交易策略3 利率期货和期权的风险管理 3.1 利率期货风险的类型 3.2 利率期货风险的评估 3.3 利率期货风险监管的国际经验 3.4 利率期权的风险量度4 世界主要利率期货和期权市场 4.1 美国国债期货市场 4.2 欧洲主要国债期货市场 4.3 亚洲的国债期货市场 4.4 美国主要期货交易所利率期权合约 4.5 欧洲期货交易所 (Eurex) 利率期货期权合约5 利率期货和期权在中国的产生与发展 5.1 国债期货的发展历程 5.2 关于“3.27”国债期货事件的回顾与思考6 我国恢复和发展国债期货的必要性和可行性 6.1 我国恢复和发展国债期货的必要性 6.2 我国开展国债期货的条件分析 6.3 国债期货的合约设计 6.4 国债期货的交易与结算制度 6.5 我国国债期货风险监管制度设计参考文献附录1 期货交易管理条例 (全文) 附录2 远期利率协议业务管理规定后记

<<利率期货与期权>>

章节摘录

1 利率期货与利率期权概述1.1 利率期货概述1.1.1 利率期货的概念和分类20世纪70年代之后,西方货币体系和世界经济格局都发生了深刻的变化,国际金融市场随之市场之也产生了重大变革,出现了诸多金融创新,其中出现的金融期货作为最典型的代表。

金融期货是金融衍生品的一种,它是为管理汇率、利率期货及股票指数期货。

利率期货的基础资产是债券类证券,是以债券类证券为标的特的期货合约,它以避免因利率波动所引起的证券价格变动而带来的风险。

利率期货的主要产品则是国债期货,它是政府债券为标的期货合同。

在这份合同里,买入者同意在约定的日期以约定的价格买入一定数量的某种国债。

下文将以我国国债期货为主要对象,介绍利率期货。

国债期货一般可分为短期国债期货和长期国债期货,前者大多以银行同业拆借市场3月期国债为标的物;后者大多以5年期以上长期债券为标的物。

目前,在期货交易比较发达的国家和地区,国债期已超过商品期货而成为成交量最大的一个类别,国债期货的成交量已占到整个期货交易总量的一半以上。

<<利率期货与期权>>

编辑推荐

《复旦博学·金融学系列·利率期货与期权》由复旦大学出版社出版。

<<利率期货与期权>>

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>