

<<金融衍生品>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生品>>

13位ISBN编号：9787505865310

10位ISBN编号：7505865315

出版时间：2007-9

出版时间：经济科学出版社

作者：唐衍伟

页数：211

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>

## <<金融衍生品>>

### 内容概要

本书以金融衍生产品——股指期货和期权为研究对象，系统研究了股指期货和期权的原理、投资交易流程与策略、市场分析与风险管理等方面，并对相关领域的最新动态进行了介绍。包括股指期货的基本概念、股指期货的投资策略（套期保值、跨期与跨市套利和期现套利以ETF程序化交易、股指期权、股指期货投资交易的流程和风险管理。

## 书籍目录

第1章 股票指数1.1 股票指数编制的基本原则1.2 股价平均数的计算方法1.3 股票指数的计算1.4 主要股票指数介绍第2章 股指期货介绍2.1 股指期货的产生与发展2.2 股指期货的功能2.3 股指期货市场的组织结构2.4 股指期货的交易方式2.5 沪深300与新华富时A50股指期货合约第3章 股指期货套期保值3.1 套期保值的原理3.2 套期保值的交易策略3.3 股票的Beta值(β)3.4 套期保值比第4章 股指期货跨期与跨市套利4.1 股指期货跨期套利4.2 股指期货跨市套利4.3 跨期与跨市套利交易的成本与风险第5章 股指期货期现套利5.1 期货价格与现货价格的关系5.2 持有成本定价模型5.3 股指期货期现套利原理5.4 无套利区间的构建5.5 股指期货期现套利的操作流程5.6 模拟投资组合的构建5.7 指数模拟绩效评价5.8 股指期货的到期日效应5.9 期现套利的风险分析第6章 ETF与股指期货6.1 ETF的产生与发展6.2 ETF的组织结构6.3 ETF的结构特征6.4 ETF的优点6.5 ETF的功能6.6 ETF与股指期货的异同6.7 上证50ETF介绍6.8 ETF与股指期货套利第7章 程序化交易7.1 程序化交易的概念7.2 程序化交易的主要交易策略7.3 程序化交易的风险7.4 美国对程序化交易的限制第8章 股指期货8.1 股指期货的基本概念8.2 股指期货的产生与发展8.3 股指期货的类型8.4 股指期货合约的构成要素8.5 股指期货与期货的联系与区别8.6 股指期货的价格8.7 股指期货基本交易策略8.8 股指期货套期保值8.9 股指期货套利第9章 投资交易与风险管理9.1 股指期货交易流程9.2 股指期货的风险管理第10章 市场研判10.1 基本面分析10.2 技术分析附录：世界主要股指期货合约参考文献

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>