

<<沪深300股指期货与投资策略>>

图书基本信息

书名：<<沪深300股指期货与投资策略>>

13位ISBN编号：9787563814817

10位ISBN编号：7563814817

出版时间：2007-10

出版时间：首都经济贸易大学出版社

作者：康跃

页数：183

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>

## <<沪深300股指期货与投资策略>>

### 前言

国内第一只金融衍生品——沪深300股指期货，即将推出，这将对我国资本市场的发展起到积极的推动作用。

股指期货是全球金融一体化、国际化和自由化背景下，现代资本市场高度发展的产物。

20世纪70年代，因石油危机产生的影响，西方各国经济发展极不稳定，汇率、利率剧烈动荡，股票市场价格大幅度波动，促使人们重新审视运用金融创新手段，以期货产品为工具管理和规避金融市场剧烈波动的风险，金融期货因此应运而生。

1972年，芝加哥商业交易所率先推出外汇期货；1975年，芝加哥期货交易所推出利率期货；1982年，美国堪萨斯期货交易所推出价值线股指期货合约。

经过短短30多年的发展，目前，金融期货品种的交易量已占全球期货交易量的80%，而股指期货无疑是金融期货中历史最短同时又是发展最快的金融衍生品。

目前国内投资者对这一金融衍生产品还较少有了解，对其功能、操作策略尚难以把握，本书希望能为此提供帮助。

本书的第一章讨论了金融衍生品的种类、交易场所、交易规则并简单介绍和分析了金融衍生品的工具——金融数学的基本概念。

第二章介绍了期货交易的组织机构、期货合约的条款和持有成本定价模型。

第三章讨论了对金融衍生品进行定价的数学模型，包括二项式模型、Black—Scholes模型和蒙特卡洛模拟方法。

第四章介绍了沪深300股指期货的条款，探讨了股指期货定价模型，研究了如何计算股指期货公平值和无套利边界，介绍了程序交易的概念等。

第五章研究了如何构建现货组合来模拟股指期货的标的指数变动趋势。

现货组合是投资者进行套利交易和套期保值的重要依据，为了衡量现货组合的跟踪效率，本章还研究了跟踪误差问题，并利用沪深300指数的成份股和ETF创建现货组合及比较它们的跟踪误差。

第六章讨论了建立在股指期货上的投资策略，包括套利交易、套期保值、投资组合管理和投机策略等。

本书的特点是提供了计算股指期货和期权公平值、套利边界、现货组合与标的指数之间的跟踪误差及创建现货组合的各种数学模型和方法，并利用仿真沪深300股指期货合约数据和沪深300指数成份股数据予以实现，这些结果可用Excel电子表格实现。

本书为国内从事金融工程的机构投资者、私募基金和套利投资者进行股指期货交易提供了实战的理论基础和实际操作的方法，同时也可金融专业的学生学习金融衍生产品的交易技巧提供帮助。

## <<沪深300股指期货与投资策略>>

### 内容概要

国内第一只金融衍生产品——沪深300股指期货，即将推出，这将对我国资本市场的发展起到积极的推动作用。

股指期货是全球金融一体化、国际化和自由化背景下，现代资本市场高度发展的产物。

本书的特点是提供了计算股指期货和期权公平值、套利边界、现货组合与标的指数之间的跟踪误差及创建现货组合的各种数学模型和方法，并利用仿真沪深300股指期货合约数据和沪深300指数成份股数据予以实现，这些结果可用Excel电子表格实现。

本书为国内从事金融工程机构投资者、私募基金和套利投资者进行股指期货交易提供了实战的理论基础和实际操作的方法，同时也可作为金融专业的学生学习金融衍生产品的交易技巧提供帮助。

<<沪深300股指期货与投资策略>>

书籍目录

第一章 金融衍生品和分析工具 1.1 金融衍生品 1.2 金融衍生品交易市场 1.3 金融工程 1.4 资金的时间价值 1.5 金融资产价格变动的随机特征 1.6 随机积分的基本知识第二章 金融期货 2.1 期货交易所 2.2 期货合约条款和交易流程 2.3 结算机构 2.4 金融期货合约 2.5 金融期货合约的价值 2.6 持有成本定价模型第三章 金融衍生品定价模型 3.1 无套利原理 3.2 二项式模型 3.3 Black-Scholes模型 3.4 蒙特卡洛模拟方法第四章 股指期货定价模型 4.1 沪深300股指期货介绍 4.2 股指期货定价模型 4.3 无套利边界 4.4 程序交易第五章 现货组合创建方法 5.1 跟踪误差 5.2 现货组合创建方法 5.3 现货组合实证分析第六章 股指期货与投资策略 6.1 金融工程与股指期货 6.2 套利交易 6.3 套期保值 6.4 投资组合管理 6.5 投机策略附录参考文献

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>