

《中外期货期权交易理论与实务》

图书基本信息

书名：《中外期货期权交易理论与实务》

13位ISBN编号：9787561829387

10位ISBN编号：7561829388

出版时间：2009-2

出版社：天津大学出版社

作者：刘超

页数：297

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.tushu111.com

《中外期货期权交易理论与实务》

内容概要

《中外期货期权交易理论与实务》通过对中外期货、期权交易制度的比较，全面、详细地阐述了中外期货、期权的产生、发展、功能以及作用。注重理论与实务相结合，论述由浅入深，把复杂的交易策略转化为一般的交易策略，便于读者认知各种交易策略的真谛。书中数据与现实相结合，其目的是便于读者了解当今期货、期权的市场价格和发展状况，同时还介绍了我国拟推出的沪深300指数期货合约以及正在交易的各种权证的相关原理。

《中外期货期权交易理论与实务》

书籍目录

第一章 中外期货交易概述第一节 中外期货交易的产生与发展第二节 期货的特征、功能与作用第三节 中外期货市场的组织结构第四节 中外期货合约的基本内容第二章 中外期货交易制度与流程第一节 中外期货交易制度第二节 中外期货交易流程第三章 商品期货交易与套期保值第一节 期货套期保值概述第二节 套期保值的分类与应用第三节 基差与基差应用第四节 基差与套期保值效果分析第五节 基差交易与套期保值第四章 商品期货交易与投机第一节 期货投机交易概述第二节 期货投机交易过程第五章 商品期货交易与套利第一节 期货套利交易概述第二节 价差交易策略及应用第三节 套利的种类与应用第四节 期货套利的交易过程第六章 金融期货交易第一节 金融期货概述第二节 外汇期货第三节 利率期货第四节 股票指数期货第五节 股票期货第七章 期货定价原理第一节 期货定价的一般原理第二节 商品期货的定价第三节 金融期货的定价第八章 中外期权交易概述第一节 中外期权的产生与发展第二节 期权的概念与分类第三节 期权合约与交易流程第九章 期权交易的基本策略与应用第一节 期权交易的基本策略第二节 股票期权的交易策略与应用第三节 股票指数期权的交易策略与应用第四节 利率期权的交易策略与应用第五节 外汇期权的交易策略与应用第六节 期货期权的交易策略与应用第十章 期权交易的合成与套利策略第一节 期权交易的合成策略第二节 期权交易的价差套利（垂直与水平套利）策略第三节 期权交易的跨式与宽跨式套利策略第四节 期权交易的转换套利和反向转换套利策略第五节 期权交易的蝶式套利策略第六节 期权交易的飞鹰式套利策略第十一章 期权定价原理第一节 期权价格的构成与影响因素分析第二节 二叉树期权定价模型第三节 布莱克-斯科尔斯（Black-Scholes）期权定价模型参考文献

第一章 中外期货交易概述 第一节 中外期货交易的产生与发展 一、期货交易的起源

期货交易最早萌芽于13世纪的欧洲，是现货交易得到广泛发展的必然产物。早在古希腊和古罗马时期，在现货交易广泛发展的基础上，欧洲许多国家都形成了中心交易场所以及无数的定期集贸市场，如罗马议会大厦广场、雅典的交易市场等。它们都是按照既定的时间和场地进行大量的现货交易活动，随着现货交易的不断发展，这些中心交易场所便出现了大宗易货交易、远期交易性质的交易活动。

1251年，英国大宪章正式允许外国商人到英国参加季节性交易会，在贸易中出现了对在途货物提前签署文件，标明商品的品种、数量、价格，预交保证金购买进而买卖文件合同的现象。1571年，英国创立了世界上第一家集中的商品市场——伦敦皇家交易所，这是西方历史上记载的第一个正式交易所。皇家交易所是以现货交易为主，在交易所内，经纪商们很快发展起来，他们和商品生产者签订远期合约，承担人们期望规避的交易风险，经纪商们在远期交易中赚取可能产生的利润。1666年，皇家交易所毁于伦敦大火，但交易仍然在伦敦的几家咖啡馆中进行；后来在其原址成立了伦敦国际金融期货期权交易所。

二、境外期货交易的产生背景分析

(一) 美国期货市场的产生 1. 芝加哥期货交易所 (Chicago Board of Trade CBOT) 的产生 19世纪30~40年代，美国大规模开发中西部地区，由于芝加哥小村毗邻美国中西部地区和密歇根湖而成为重要的粮食集散地。中西部的谷物汇集于此并运往东部消费区，但是由于受储存、季节、交通运输和信息传递不同步的影响，粮食价格波动较大，粮食销售商和粮食加工商往往承受较大的价格风险，因而1848年芝加哥的82位商人组建了芝加哥期货交易所。这时的期货交易所的主要功能有三个：一是改进运输和存储条件；二是为会员提供价格信息服务；三是促进买卖双方达成交易。

《中外期货期权交易理论与实务》

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.tushu111.com