

《股指期权研究成果汇编》

图书基本信息

书名：《股指期权研究成果汇编》

13位ISBN编号：9787506074222

出版时间：2014

作者：中国金融期货交易所股指期权小组

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

《股指期权研究成果汇编》

内容概要

中国金融期货交易所股权类期货期权小组(简称中金所股权小组)对上市股指期权的意义、做市商制度、期权保证金制度、期权执行方式以及期权与权证异同点等股指期权合约与制度设计中的核心和关键问题进行了全面深入的比较研究,并结合境内市场现状,探索境内上市股指期权产品的可适用制度。为推动金融期货与期权研究的深化,以及为股指期权的上市创造良好的社会环境和研究氛围,中金所股权小组整理了相关期权研究成果,汇编了股指期权研究报告。希望本成果汇编的出版,能够起到促进交流、提高认识、深化金融期货和期权研究的作用。

《股指期权研究成果汇编》

作者简介

中国金融期货交易所(China Financial Futures Exchange,缩写CFFE)，是经国务院同意，中国证监会批准，由上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、上海证券交易所和深圳证券交易所共同发起设立的交易所，于2006年9月8日在上海成立。5家股东分别出资1亿元人民币，按照中国证监会前期任命，朱玉辰为中国金融期货交易所首任总经理。上市品种由沪深300指数期货首发登场。道富投资认为，中国金融期货交易所的成立，对于深化资本市场改革，完善资本市场体系，发挥资本市场功能，具有重要的战略意义。

书籍目录

序言

第一部分 股指期权概述

第一篇 股指期权的功能与作用

第二篇 期权的法律属性和法律适用研究

第三篇 期权与权证的比较

第四篇 股指期权与ETF期权的比较

第二部分 境外股指期权发展经验

第五篇 境外股指期权发展路径分析

第六篇 境外股指期权市场风险防范研究与借鉴

第七篇 境外股指期权市场交割情况分析借鉴

第八篇 境外期权相关交易指令研究借鉴

第三部分 股指期权市场设计

第九篇 股指期权市场做市商制度分析

第十篇 股指期权市场保证金模式比较研究

第十一篇 我国台湾股指期权结算保证金AB值法研究借鉴

第十二篇 股指期权行权方式和行权流程的比较

第四部分 股指期权功能与作用

第十三篇 《南森报告》对美国期权上市初期市场影响分析

第十四篇 《四方报告》对美国期权上市初期市场影响分析

第十五篇 现货价格变动时期权卖方与期货投资风险对比

第十六篇 股指期货上市对股票市场影响

第十七篇 股指期权上市对股票市场波动性的影响

第十八篇 VIX指数期货与期权对美国股票市场的影响

后记

1、《股指期货研究成果汇编》的笔记-第30页

股指期货自1983年诞生以来，发展十分迅速，已经成为国际衍生品市场的重要组成部分。股指期货的出现拓展了国际金融衍生品市场，为投资者提供了新的投资渠道和风险管理方式，有助于提高股票市场和期货市场的运行质量，促进市场功能发挥。目前，我国境内市场还未推出期权产品，风险管理工具较为单一，尚不能充分满足市场更加多元和精细化的风险管理需求。在这种情况下，积极稳妥地推出股指期货，对于优化我国金融期货产品体系，丰富市场交易品种，完善市场风险管理机制，促进市场功能发挥，推进资本市场健康稳定发展，具有重要意义。

我国资本市场在短短20多年的时间里，取得了巨大成就，目前已成为全球第二大资本市场，有着全球最大的投资者群体，国际影响力也大大增强，但我国资本市场风险管理体系不完整，证券期货经营机构的实力还无法与国际同行相比，难以满足实体经济对投融资和风险管理服务的需求。发展我国期权市场不仅有助于完善资本市场风险管理体系和改善投资者行为交易行为，而且还将大力推动我国金融机构的业务创新和提高金融机构的服务能力。因此，积极稳妥推进期权产品创新，对于推动我国资本市场长期健康发展有着特殊的意义。

实现股指期货的平稳推出，需要市场各方的积极配合，客观认识股指期货的功能和作用，深入研究境外市场股指期货合约与制度设计。中金所股权小组对上市股指期货的意义、做市商制度、期权保证金制度、期权执行方式以及期权与权证异同点等股指期货合约与制度设计中的核心和关键问题进行全面深入的比较研究，结合境内市场现状，探索境内上市股指期货产品的可适用制度。为了推动金融期货与期权研究的深化，为股指期货的上市创造良好的社会环境和研究氛围，中金所股权小组整理了相关期权研究成果，编写了股指期货研究报告汇编。希望本报告汇编的出版，能够起到促进交流、提高认识、深化金融期货和期权研究的作用。

《股指期权研究成果汇编》

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