

# 《奇异期权交易》

## 图书基本信息

书名：《奇异期权交易》

13位ISBN编号：9787564220392

出版时间：2015-3

作者：弗兰斯·德·韦尔特

页数：135

译者：陈学彬

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](http://www.tushu111.com)

# 《奇异期权交易》

## 内容概要

《奇异期权交易/东航金融衍生译丛》由资深交易员和顾问弗兰斯·德·韦尔特所著，使用风险导向的方法介绍奇异期权的定价。通过向读者提供理解奇异期权的结构化产品，本书也让读者能够对最基础或最复杂的奇异期权进行定价和风险管理。

德·韦尔特从解释与交易奇异期权相关的风险开始，继而以不仅仅进行数学推导的方式详尽分析了这些风险背后的经济学原理以及奇异期权的价格敏感性指标。本书所用的数学结构化产品只为解释奇异期权服务，并结合实际操作中的案例让读者能够从实践的角度理解数理定价公式。

本书内容包括普通期权、数字期权、障碍期权、棘轮期权、双币种期权、绩优期权、方差互换，同时以简洁明了的方式解释了复杂的概念，让读者能够全面地理解每种奇异期权。本书还介绍了嵌入奇异期权的结构性票据，例如反向可转换票据，可赎回和可卖回反向可转换票据和自动赎回票据，并介绍了其原理和相关风险。

对于每一种奇异期权产品，作者提出了为什么投资者会需要特定的奇异期权；解释了每种奇异期权存在哪些风险，同时这些风险如何影响定价；说明了如何最优地对冲每种奇异期权的维加和伽马暴露；并单独讨论每种奇异期权的偏度暴露。

《奇异期权交易》一书在介绍数学推导和定价结构化产品之外通过解释每种奇异期权的实际操作意义以及如何影响定价，有效地消除了奇异期权的神秘性，使读者全面理解每种奇异期权，并使讨论的内容在实际操作中成为可用的结构化产品。

# 《奇异期权交易》

## 书籍目录

总序	
译者序	
前言	
致谢	
第1章	引言
第2章	传统期权、远期和价格敏感性指标
第3章	基于伽马的收益及其和西塔的关系
第4章	现金德尔塔和现金伽马
第5章	偏度
第6章	简单的期权交易策略
第7章	蒙特卡罗模拟
第8章	任选期权
第9章	数字期权
第10章	障碍期权
第11章	远期生效期权
第12章	阶梯期权
第13章	回望期权
第14章	棘轮期权
第15章	反向可转换
第16章	自动赎回
第17章	可赎回和可卖回的反向可转换
第18章	亚式期权
第19章	双币种期权
第20章	复合期权
第21章	绩优期权
第22章	最优和最劣期权
第23章	方差互换
第24章	离差
第25章	金融结构化产品的构建
附录A	复合期权和绩优期权的方差
附录B	复制方差互换的收益特征

# 《奇异期权交易》

## 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](http://www.tushu111.com)