

# 《股指期货套保与套利》

## 书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2010年07月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787547601907

丛书名：股指期货知识系列丛书

## 内容简介

《股指期货套保与套利》围绕股指期货套保、套利原理，并结合海外实例和学术研究结果，对股指期货的套保、套利交易进行了比较详细的介绍。相信对于广大股指期货投资者如何实现有效规避系统性风险具有指导和帮助作用。

## 作者简介

方世圣，台湾股指期货专家、湖北卫视《左道财门》特邀嘉宾、上海东证期货副总经理。

## 目录

### 总序

#### 主编的话

#### 第一章 股指期货简介

##### 第一节 股指期货的特性

##### 第二节 股指期货合约的主要条款

##### 第三节 市场参与者与基本操作模式

##### 第四节 股指期货的主要优势

##### 第五节 股指期货功能的探讨

#### 第二章 系统性风险的规避

##### ——股指期货套期保值

##### 第一节 定义与基本原理

##### 第二节 市场系统性风险

##### 第三节 套期保值原理

##### 第四节 套期保值操作实例

##### 第五节 套期保值比率的确定

##### 第六节 利用股指期货构建市场中性组合

##### 第七节 套期保值的另一种工具——期权

#### 第三章 套期保值也有风险

##### 第一节 套期保值操作流程实务

##### 第二节 风险与因应之道

#### 第四章 对冲基金如何运用股指期货

##### 第一节 对冲基金的主要类型与运用策略

##### 第二节 股指期货的应用方式

#### 第五章 股指期货的套利交易——理论篇

- 第一节 股指期货的套利理论
- 第二节 程序化交易与股指期货套利
- 第三节 股指期货的持有成本模型
- 第四节 股指期货的预期理论
- 第五节 套利操作中的现货股票做空机制
- 第六章 股指期货的套利交易——实战篇
  - 第一节 交易过程中应注意的事项
  - 第二节 套利策略模式
  - 第三节 期现套利交易的方法与步骤之一：期货的理论价格
  - 第四节 期现套利交易的方法与步骤之二：现货组合的构建
  - 第五节 境外股指期货期现套利的实践分析
  - 第六节 跨期价差套利交易
  - 第七节 股指期货的其他套利交易
  - 第八节 股指期货套利交易风险

## 在线试读部分章节

### 第一章 股指期货简介

股指期货(Stock Index Futures)的全称是股票价格指数期货，也可称为股价指数期货、期指，它是基于股票价格指数的标准化期货合约。合约约定双方在未来的某个特定日期(结算日)，可以按照事先约定的股价指数的点位，进行标的指数的买卖。

作为期货交易的一种类型，股指期货交易与普通商品期货交易具有基本相同的特征和流程。但同时它 also 具有许多与商品期货不同的重要特性。

据彭博社(Bloomberg)的不完全统计，目前，全球共有74种主要指数拥有上百种期货合约(见图1.1)。一般来说，股指期货合约具有本土特性，即采用本土的股价指数开发股指期货合约。但随着国际金融市场一体化进程的推进，一些对全球或地区经济有指标意义的指数也会被其他市场采用，例如，日经225指数的股指期货就同时在大阪交易所(OSE)、新加坡交易所(SGX)和芝加哥商业交易所(CME)交易。

.....

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