

<< 《期权、期货及其他衍生产品》 >>

图书基本信息

书名：<< 《期权、期货及其他衍生产品》习题集 >>

13位ISBN编号：9787111300144

10位ISBN编号：7111300149

出版时间：2010-3

出版时间：机械工业出版社

作者：约翰·赫尔

页数：267

译者：庄新田,黄玮强

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>

前言

本书包括《期权、期货及其他衍生产品》（第7版）的章后习题和习题答案，这些习题有助于读者自学和自测。

无论读者是否认为它们是更具挑战性的分析技术应用，它们都可以作为要点方便读者查阅。

本书中的某些问题使得教材中的结论得到了证明或拓展。

为了使本书的读者能够最大化的受益，建议读者不要轻易查阅本书的答案。

<< 《期权、期货及其他衍生产品》 >>

内容概要

本书是《期权、期货及其他衍生产品》（第7版）配套习题集。
本书为许多金融从业人员解决实际问题提供了很好的指导。
适用于高等院校金融相关专业教学参考，也可作为金融机构管理者的参考书，特别是衍生产品从业人员的参考书。

<< 《期权、期货及其他衍生产品》 >>

书籍目录

前言 译者序 第1章 导言 第2章 期货市场的运作机制 第3章 利用期货的对冲策略 第4章 利率 第5章 远期和期货价格的确定 第6章 利率期货 第7章 互换 第8章 期权市场的运作过程 第9章 股票期权的性质 第10章 期权交易策略 第11章 二叉树简介 第12章 维纳过程和伊藤引理 第13章 布莱克-斯科尔斯-默顿模型 第14章 雇员股票期权 第15章 股指期货与货币期权 第16章 期货期权 第17章 希腊值 第18章 波动率微笑 第19章 基本数值方法 第20章 风险价值度 第21章 估计波动率和相关系数 第22章 信用风险 第23章 信用衍生产品 第24章 特种期权 第25章 气候、能源以及保险衍生产品 第26章 再论模型和数值算法 第27章 鞅与测度 第28章 利率衍生产品：标准市场模型 第29章 曲率、时间与Quanto调整 第30章 利率衍生产品：短期利率模型 第31章 利率衍生产品：HJM和LMM模型 第32章 再谈互换 第33章 实物期权

章节摘录

解答：若在交割期间内期货价格大于即期价格，套利者可以在买入资产的同时做空期货合约，从而迅速完成交割并赚取利润。

若在交割期间内期货价格小于即期价格，则不存在与上述类似的完美套利策略。

此时，套利者可以做多期货合约，但无法迅速完成资产的交割，这是因为交割时间是由期货合约的空头来确定的。

然而，对于想获得交割资产的公司，做多期货合约并等待资产交割的行为将是有好处的。

解释触及市价指令与止损指令的区别。

解答：触及市价指令是当价格达到指定水平或者比指定水平更为有利时才执行交易的指令。

止损指令是在买入价或卖出价达到某一指定价格或更低价格时，按照最为有利的价格执行交易的指令。

。

解释止损限价指令中，限价为20.10美元时以20.30美元卖出的含义是什么？

+解答：限价为20.10美元时以20.30美元卖出的止损限价指令的意思是，当市场上出现买入价为20.30美元时，这一指令变为限价为20.10美元的限价指令，即卖出价应该达到20.10美元或更高。

在某一天末，某结算中心会员持有100个合约的长头寸，结算价格为每个50000美元，最初保证金为每个合约2000美元。

在第2天，这一会员又以51000（每个合约）美元进入20个长头寸，在第2天末的结算价格为50200美元。

。

这个会员要向结算中心追加多少附加保证金？

解答：该结算中心会员需要为新合约提供 20×2000 美元=40000美元的初始保证金。

第2天，现有的合约盈利 $(50200-50000) \times 100=20000$ （美元），同时新合约也损失 $(51000-50200) \times 20=16000$ （美元）。

该会员因此需追加 $40000-20000+16000=36000$ （美元）保证金。

在2009年7月1日，某家日本公司进入面值为100万美元的远期合约。

在合约中，该公司同意在2010年1月1日买入100万美元。

在2009年9月1日，这家公司又进入一个在2010年1月1日卖出100万美元的远期合约。

将公司的日元盈亏描述为在2009年7月1日和2009年9月1日的远期汇率的函数。

<< 《期权、期货及其他衍生产品》 >>

编辑推荐

《期权、期货及其他衍生产品 习题集（第7版）》是约翰·赫尔亲自主笔为《期权、期货及其他衍生产品》（第7版）编写的配套习题集及答案。全书对《期权、期货及其他衍生产品》（第7版）教材的600多道练习题进行了详细解答，由浅入深，切中要害。此外，许多习题本身包含金融衍生产品的实践背景，使读者能理论联系实际、近距离地接触实践操作，为专业学生和相关金融从业人员解决实际问题提供了指导。

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>