

Kontrakty terminowe i opcje

John Hull

SPIS TREŚCI

1. Wprowadzenie

KONTRAKTY FUTURES I FORWARD

2. Mechanizmy działania rynków transakcji terminowych
3. Obliczanie cen futures i forward
4. Strategie zabezpieczające przy użyciu transakcji futur es
5. Procentowe kontrakty futures
6. Transakcje swapowe

KONTRAKTY OPCYJNE

7. Mechanizmy działania rynków opcji
8. Podstawowe właściwości opcji na akcje
9. Strategie inwestycyjne wykorzystujące opcje
10. Wstęp do analizy drzew dwumianowych
11. Blacka-Scholesa model wyceny opcji
12. Opcje na indeksy i waluty

13. Opcje na kontrakty futur es
14. Pozycje zabezpieczające w opcjach a syntetyczne tworzenie kontraktów opcyjnych
15. Wycena opcji przy pomocy drzew dwumianowych
16. Zaburzenia modelu Blacka-Scholesa
17. Opcje procentowe