

第五章金融衍生工具复习重点证券从业资格考试 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/596/2021_2022__E7_AC_AC

[_E4_BA_94_E7_AB_A0_E9_c33_596732.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/596/2021_2022__E7_AC_AC_E4_BA_94_E7_AB_A0_E9_c33_596732.htm) 掌握金融衍生工具的概念、基本特征和按照基础工具的种类、交易形式及交易方法等不同的分类方法。了解金融衍生工具产生和发展的原因、金融衍生工具最新的发展趋势。掌握远期、期货与互换交易的定义、基本特征和主要区别；了解现阶段银行间债券市场远期交易、外汇远期交易、外汇互换交易以及境外人民币NDF的基本情况。掌握金融期货合约的主要类别，了解境外金融期货合约的主流品种和交易规则。掌握金融期货的套期保值功能和价格发现功能。掌握金融期货的集中交易制度、标准化期货合约和对冲机制、保证金制度、无负债结算制度、限仓制度、大户报告制度等主要交易制度。了解金融期货的理论价格及影响价格的主要因素。百考试题编辑 了解互换交易的主要类别和交易特征。掌握金融期权的定义和特征。掌握金融期货与金融期权在标的物、权利与义务的对称性、履约保证、现金流转、盈亏特点、套期保值的作用与效果等方面的区别。了解金融期权按投资者的买卖行为、合约履行时间、期权标的物性质划分的主要种类。了解金融期权的主要功能。掌握期权的内在价值和时间价值，了解期权价格的主要影响因素。掌握可转换证券的定义和特征，掌握可转换证券的主要要素。掌握可转换证券的理论价值、转换价值，并能熟练运用有关公式计算可转换证券的理论价值和转换价值。了解可转换证券的市场价格及转换升贴水。百考试题编辑 掌握权证的定义、类别和特征，了解权证与标准期权产

品的异同。了解目前中国证券市场中权证类产品的基本结构。掌握存托凭证的定义，了解美国存托凭证种类以及与美国存托凭证的发行和交易相关的机构，了解推出中国存托凭证相关建议的含义。掌握资产证券化的含义、机制以及证券化资产的主要种类。了解目前中国银行业信贷资产证券化和房地产信托投资单位的现状与发展趋势。掌握结构化衍生产品的含义，了解中国结构化金融产品的发展趋势。百考试题编辑 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com