1 / 3

2017 年“期货投资分析”考试大纲

“期货投资分析”考试内容包括参考教材《期货及衍生品
分析与应用》中的有关知识和应用,上述知识需要涉及“期货基
础知识”考试中的知识。

第一章 宏观经济指标
第一节 主要经济指标
第二节 货币金融指标
第三节 其他重要指标

第二章 衍生品定价
第一节 远期与期货定价
第二节 期权定价
第三节 互换定价

第三章 定性与定量分析
第一节 定性分析
第二节 定量分析

第四章 量化交易
第一节 量化交易系统的构建
第二节 量化模型的测试评估

2 / 3

第三节 量化交易的特定风险及其管理

第五章 商品期货及衍生品应用
第一节 在货物贸易中的应用
第二节 在库存风险管理中的应用
第三节 在融资中的应用

第六章 金融期货及衍生品应用
第一节 权益类衍生品应用
第二节 利率类衍生品应用
第三节 汇率类衍生品的应用

第七章 场外衍生品
第一节 场外期权
第二节 场外互换
第三节 信用衍生品

第八章 结构化产品
第一节 产品构造与业务模式
第二节 权益类结构化产品
第三节 利率类结构化产品
第四节 汇率类结构化产品

第九章 金融衍生品业务风险管理

3 / 3

第一节 风险识别
第二节 风险度量
第二节 风险对冲