

## 2022 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 宏观经济分析与指标**

第一节 宏观经济分析框架

第二节 主要经济指标

第三节 货币金融指标

### **第二章 期货及衍生品定价**

第一节 远期与期货定价

第二节 期权定价

第三节 期权中常见的希腊字母及波动率

### **第三章 统计与计量分析**

第一节 统计分析

第二节 线性回归分析

第三节 时间序列分析

## **第四章 商品期货及衍生品分析与应用**

第一节 商品期货价格影响因素

第二节 在实体企业中的应用

第三节 在资产配置中的应用

第四节 在促进农业发展中的应用

## **第五章 股指期货及衍生品分析与应用**

第一节 分析方法

第二节 交易策略

第三节 产品开发与应用

## **第六章 国债期货及衍生品分析与应用**

第一节 我国国债价格分析与供需格局

第二节 国债期货套期保值策略与应用

第三节 国债期货套利策略与应用

第四节 利率期权

## **第七章 外汇期货及衍生品分析与应用**

第一节 影响汇率的因素

第二节 外汇远期与掉期交易

第三节 外汇期货与期权应用策略

第四节 汇率类衍生品在风险管理中的应用

## **第八章 场外衍生品**

### 第一节 远期

### 第二节 互换

### 第三节 场外期权

### 第四节 信用衍生品

## **第九章 结构化产品**

### 第一节 权益类结构化产品

### 第二节 利率类结构化产品

### 第三节 汇率类结构化产品

## **第十章 衍生品业务风险管理**

### 第一节 风险识别

### 第二节 风险度量

### 第二节 风险对冲