附件1：

上交所期权策略顾问（初级班）培训

课程表

|  |  |
| --- | --- |
| **课程名称** | 培训内容 |
| **第一讲：****期权的基础知识**  | 期权的概念与基本功能；期权的合约要素、上交所股票期权的合约设计、期权的价值、影响期权价值的因素、希腊字母简介。 |
| **第二讲：****单腿期权策略** | 买认购、卖认购、买认沽、卖认沽的盈亏分析；买入开仓的使用场景与风险点、买入开仓的90/10策略；卖出开仓的使用场景与风险点、保证金、强行平仓制度。 |
| **第三讲：****保险策略与备兑开仓** | 保险策略的使用场景、盈亏分析与注意事项；备兑开仓策略的使用场景、盈亏分析、风险特征和注意事项；卖出认沽买股票策略的应用。 |
| **第四讲：****组合策略入门** | 牛市价差组合、熊市价差组合、合成股票策略、跨式、宽跨式组合盈亏与案例分析、组合策略保证金及其应用。 |
| **第五讲：****行权交收和限仓限购制度，以及股票期权发展现状和实例** | 上交所期权行权交收制度、限仓限购制度。上交所期权市场发展情况介绍、介绍客户端使用方法和行情浏览，分享实践案例。 |

以培训时课程表为准。