附件1：

第58期“上交所期权策略顾问培训班（初级班）”

课程安排

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **日期** | **时间** | **课程名称** | 培训内容 |
| 3月21日 | 8:00-8:50 | 签到 |
| 9:00—10:00 | 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 |
| 10:00—10:15 | 课间休息 |  |
| 10:15—11:45 | 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、限仓、限购制度；卖出开仓的使用场景与风险点、保证金、强行平仓制度 |
| 11:45—13:30 | 午休时间 |  |
| 13:30—14:45 | 第三讲：保险策略与备兑开仓 | 保险策略的使用场景、盈亏分析与风险特征、投资组合的5种保险策略对比；备兑开仓策略的使用场景、盈亏分析、风险特征和收益指标；卖出认沽买股票策略的应用 |
| 14:45-15:00 | 课间休息 |  |
| 15:00—16:00 | 第四讲：期权基础组合策略 | 牛市价差组合、熊市价差组合、股票修补策略、合成股票策略、跨式、宽跨式组合盈亏与案例分析 |
| 16:00—16:30 | 第五讲：行权交收及限仓限购制度 | 上交所期权行权交收制度、限仓限购制度、当日的知识总结与梳理、考试辅导 |
| 3月22日 | 9:00-9:45 | 股票期权新手入门 | 上交所期权市场发展情况介绍、介绍客户端使用方法、行情浏览、交易操作 |
| 9:45-10:30 | 股票期权实战案例 | 2020年、2021年交易案例分析与讨论 |
| 11：00-12：00 |  | 闭卷考试 |

以培训时课程表为准。