

朝陽科技大學 099學年度第1學期教學大綱
Futures and Options 期貨與選擇權市場

當期課號	7029	Course Number	7029
授課教師	洪志興	Instructor	HUNG,CHIH HSING
中文課名	期貨與選擇權市場	Course Name	Futures and Options
開課單位	財務金融系碩士班二A	Department	
修習別	選修	Required/Elective	Elective
學分數	3	Credits	3
課程目標	期貨與選擇權之基本概念、價格決定方法、交易流程與市場上實際商品之介紹	Objectives	This course provides on the one hand working knowledge , and the other hand theoretical basic knowledge of futures and options markets .
教材	1.Derivatives principles and practice/Rangarajan K. sundaram 2.Options futures and other Derivatives./john c. Hull.	Teaching Materials	1.Derivatives principles and practice/Rangarajan K. sundaram 2.Options futures and other Derivatives./john c. Hull.
成績評量方式	平常與報告成績 40% 期中考成績 30% 期末考成績 30%	Grading	Homework and Report 40% Midterm 30% Final Exam 30%
教師網頁	http://lms.cit.cyut.edu.tw/2009171		
教學內容	主題一: 衍生性金融商品導論 主題二: 期貨導論 主題三: 期貨評價 主題四: 期貨交易策略 主題五: 選擇權導論 主題六: 選擇權價格和交易策略 主題七: 買權賣權等價理論 主題八: Black-Scholes 公式 主題九: 選擇權二項式定價模型	Syllabus	Lecture 1: introduction to financial derivatives Lecture 2: introduction to futures market and its products Lecture 3: pricing futures Lecture 4: trading strategies for futures Lecture 5: introduction to option market and its products Lecture 6: option pricing and trading strategies Lecture 7: put-call parity Lecture 8: Black-Scholes theory Lecture 9: binomial model for option pricing

尊重智慧財產權，請勿非法影印。