

**朝陽科技大學**  
**100學年度第1學期教學大綱**

當期課號	7048	中文科名	衍生性金融商品
授課教師	李宗政	開課單位	企業管理系
學分數	3	修課時數	3
修習別	專業選修	開課班級	日間部碩士班2年級 A班
類別	一般課程		

本課程與系所培養學生核心能力關聯度	高度關聯	中高關聯	中度關聯	中低關聯	低度關聯
專業倫理與團隊合作態度。			✓		
自主學習與終身學習態度。				✓	
產業趨勢與國際視野洞察能力。		✓			
經營診斷能力。			✓		
創新策略與經營模式之規劃與執行能力。			✓		

**本課程培養學生下列知識：**

瞭解期貨契約、選擇權與金融交換等其他金融工具的經濟意義，並與其他證券之異同有所認知，俾使學生建立起如何利用衍生性金融工具進行風險管理之正確觀念。

1. 衍生性金融工具對於風險管理的意義、角色與功能。
2. 期貨市場的功能、種類、交易機制、定價模式與避險策略。
3. 選擇權市場的功能、交易機制與策略、以及相關定價模式。

Futures and options markets have become increasingly important in the world of finance and investment, this course will introduce (1) how these markets work, (2) How they can be used, and (3) what determines prices in them.

**每週授課主題**

- 第01週：Introduction
- 第02週：Mechanics of Futures and Forward Markets
- 第03週：Hedging Strategies Using Futures (1)
- 第04週：Hedging Strategies Using Futures (2)
- 第05週：Interest Rates
- 第06週：Determination of Forward and Futures Prices (1)
- 第07週：Determination of Forward and Futures Prices (2)
- 第08週：Interest Rate Futures (1)
- 第09週：Interest Rate Futures (2)
- 第10週：Swaps (1)
- 第11週：Swaps (2)
- 第12週：Securitization and the Credit Crisis of 2007
- 第13週：Mechanics of Options Markets
- 第14週：Properties of Stock Options
- 第15週：Trading Strategies Involving Options (1)
- 第16週：Trading Strategies Involving Options (2)
- 第17週：Introduction to Binomial Trees
- 第18週：Options on Stock Indices and Currencies

**成績及評量方式**

- 口頭報告：60%
- 學習態度：20%
- 平時作業及出席：20%

**證照、國家考試及競賽關係**

本課程無證照、國家考試及競賽資料。

**主要教材**

2.Hull, John C., Fundamentals of Futures and Option markets, 7th Ed.,Prentice Hall(教科書)

**參考資料**

- 書名：經濟日報 作者： 出版年(西元)： 出版社：
- 書名：工商時報 作者： 出版年(西元)： 出版社：

## 建議先修課程

本課程無建議先修課程

## 教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~john/>

E-Mail：[john@cyut.edu.tw](mailto:john@cyut.edu.tw)

Office Hour：

星期二,第3~4節,地點:T2-929;

星期四,第5~6節,地點:T2-929;

分機:4441、4441

[關閉](#) [列印](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。