

朝陽科技大學
100學年度第2學期教學大綱

當期課號	7563	中文科名	衍生性金融商品
授課教師	金鐵英	開課單位	財務金融系
學分數	3	修課時數	3
修習別	專業選修	開課班級	碩士班1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
財金理論與實務專業之能力。	✓				
研究分析與規劃執行之能力。	✓				
倫理道德與社會責任之能力。			✓		
國際視野與外國語言之能力。		✓			

本課程培養學生下列知識：

瞭解期貨、選擇權與其他衍生物的基本意義，並能認識與金融商品現貨之異同，俾使學生建立起對衍生性金融商品之正確觀念。1.說明金融衍生性商品市場的意義、角色與功能；2.期貨市場的功能、合約種類、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。

- 1.熟悉衍生性金融商品的意義、角色與功能
- 2.熟悉期貨市場的功能、合約種類、交易機制、定價模式與避險策略
- 3.熟悉選擇權市場的功能、交易機制與策略、以及相關定價模式

Futures, options and other derivatives 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 Markets
- 第03週：Hedging Strategies Using Futures
- 第04週：Interest Rates
- 第05週：Determination of Forward and Futures Prices
- 第06週：Interest Rate Futures
- 第07週：Foreign Exchange Rate Futures
- 第08週：Equity Futures
- 第09週：期中考試
- 第10週：Mechanics of Options Markets
- 第11週：Properties of Stock Options
- 第12週：Trading Strategies Involving Options
- 第13週：Binomial Trees
- 第14週：Valuing Stock Options: The B.S. Model
- 第15週：Options on Stock Indices and Currencies
- 第16週：Futures Options
- 第17週：The Greek Letters
- 第18週：期末考試

成績及評量方式

- 期中考：40%
- 期末考：40%
- 口頭報告：10%
- 平時作業及出席：10%

證照、國家考試及競賽關係

- 會計師、公務人員高考一級、二級或乙等特考、三等特考、高員級，及相當之政府考試
- 公務人員普考或丙等特考、四等特考、五等特考、員級，及相當之政府考試
- 期貨交易分析人員
- 期貨商業務員
- 期貨公司期權競賽
- 大專院校期權競賽
- 期交所期權大競賽

主要教材

2.金鐵英、金鐵珊合著，衍生性金融商品 - 期貨與選擇權，新陸書局出版(教科書)

參考資料

書名：Financial Engineering 作者：Keith Cuthbertson and Dirk Nitzsche 出版年(西元)： 出版社：John Wiley & Son LTD

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/~tieinjin/>

E-Mail：tieinjin@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期二,第3~4節,地點:T2-919;

星期三,第3~4節,地點:T2-919;

分機:4216

[關閉](#) [列印](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。