

朝陽科技大學
101學年度第1學期教學大綱

當期課號	7030	中文科名	期貨與選擇權市場
授課教師	洪志興	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	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
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：

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。

- 1.期貨與選擇權之介紹與應用
- 2.瞭解選擇權之策略分析
- 3.熟悉Black-Shole之推導
- 4.瞭解選擇權Greek之分析
- 5.學習新奇選擇權
- 6.衍生性金融商品之探討

This course provides on the one hand working knowledge, and the other hand theoretical basic knowledge of futures and options markets.

每週授課主題

- 第01週：期貨市場與交易策略
- 第02週：利率市場
- 第03週：遠期契約與利率期貨
- 第04週：SWAP
- 第05週：選擇權市場簡介
- 第06週：選擇權特性
- 第07週：選擇權交易策略
- 第08週：機率論
- 第09週：統計分配性質
- 第10週：布朗運動與平賭論
- 第11週：Ito 微積分與定理
- 第12週：二項式定價
- 第13週：B-S定價
- 第14週：差分數值分析
- 第15週：Employee stock options
- 第16週：Greek letters
- 第17週：Exotic options
- 第18週：期末考

成績及評量方式

證照、國家考試及競賽關係

- 期貨交易分析人員
- 期貨公司期權競賽
- 期交所期權大競賽

主要教材

2.options,futures, and other Derivatives. John C.Hull(教科書)

參考資料

書名：options,futures, and other Derivatives 作者：John C.Hull 出版年(西元)：2012 出版社：pearson

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/~hunpeter65/>

E-Mail：hunpeter65@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期一,第1~5節,地點:R-226;

星期二,第5~6節,地點:R-226;

分機:7852、7823

[關閉](#) [列印](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。