

朝陽科技大學
106學年度第1學期教學大綱

當期課號	7046	中文科名	衍生性金融工具
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能力指標關聯度：

核心能力	能力指標	關聯度		
		高度關聯	中度關聯	低度關聯
產業趨勢與國際視野洞察能力。	策略規劃事務規劃與執行		✓	
創新策略與經營模式之規劃與執行能力。	創新專案及創業企劃案規劃與執行			✓

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。培育學生如何整合衍生性金融工具以財務工程觀念進行風險管理。

- 1.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。
- 2.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。
- 3.培育學生如何整合衍生性金融工具以財務工程觀念進行風險管理。

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 the 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

- 學習態度：30%
- 期末考：0%
- 口頭報告：50%
- 平時作業及出席：20%
- 技術操作：0%

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

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

參考資料

本課程無參考資料!

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

Office Hour：

星期一,第5~6節,地點:T2-929;

星期三,第3~4節,地點:T2-929;

分機:4441

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。