

朝陽科技大學
109學年度第1學期教學大綱

當期課號	1274	中文科名	期貨與選擇權
授課教師	王昭貴	開課單位	保險金融管理系
學分數	2	修課時數	2
		開課班級	日間部四年制4年級 A班
修習別	專業選修		
類別	一般課程		

本課程培養學生下列知識：

期貨與選擇權是一門介紹衍生性金融商品相關理論與實務的課程，本課程首先探討期貨契約、期貨交易策略、選擇權價格行為、買賣權平價理論，以及選擇權的交易策略。本課程之課程目標為：(一) 認識期貨契約、(二) 理解期貨交易策略、(三) 認識選擇權價格行為、(四) 熟悉買賣權平價理論、(五) 認識選擇權的交易策略。

1. 認識期貨契約
2. 理解期貨交易策略
3. 認識選擇權價格行為
4. 熟悉買賣權平價理論
5. 認識選擇權的交易策略

Futures and Options is a course introducing the basic theory and practice in futures and options markets. This course includes the following issues: futures contracts, trading strategy in futures markets, price behavior of options, put call parity, and trading strategy in options markets. The goals of this course include (1) understanding the futures contracts, (2) understanding the trading strategy in futures markets, (3) understanding the price behavior of options, (4) understanding the put call parity, and (5) understanding the trading strategy in options markets.

每週授課主題

- 第01週：期貨概論
- 第02週：期貨市場之交易制度
- 第03週：期貨的避險策略
- 第04週：期貨的投機與價差策略
- 第05週：認識股價指數期貨
- 第06週：認識外匯期貨
- 第07週：利率期貨的標的物種類
- 第08週：利率期貨的應用
- 第09週：期中測驗
- 第10週：選擇權概論
- 第11週：選擇權市場之交易制度
- 第12週：如何決定選擇權的價值
- 第13週：熟悉選擇權評價理論
- 第14週：認識選擇權的基本交易策略
- 第15週：認識選擇權的進階交易策略
- 第16週：選擇權風險管理
- 第17週：台灣期權市場之最新動態
- 第18週：期末測驗

成績及評量方式

- 期中測驗：20%
期末測驗：30%
平時上課表現參與討論：20%
其他(期貨業務員證照)：30%

證照、國家考試及競賽關係

- 期貨商業業務員
- 期貨分析師

主要教材

1. 衍生性金融商品謝劍平智勝978-957-43-4603-520177月再版(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/~hdliu/>

E-Mail：hdliu@cyut.edu.tw

Office Hour：

分機：

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。