

朝陽科技大學
112學年度第2學期教學大綱

當期課號	1086	中文科名	選擇權市場
授課教師	林俊良	開課單位	財務金融系
學分數	2	修課時數	2
		開課班級	日間部四年制3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：

本課程目標在於傳授選擇權市場的基本理論與實務運作，內容包括：股票選擇權、股指選擇權、利率選擇權、匯率選擇權、與期貨選擇權。

- 1.熟悉股票選擇權
- 2.瞭解股價指數選擇權
- 3.認識利率選擇權
- 4.瞭解匯率選擇權
- 5.分析原物料選擇權
- 6.學習選擇權之訂價公式

This course is designed for undergraduate students to understand the fundamental theories and practical operations of the options markets. The underlying assets essentially included equities, interest rates, foreign exchanges, and futures.

每週授課主題

- 第01週：Introduction of Options Markets
- 第02週：Mechanics of Options Markets
- 第03週：Properties of Stock Options
- 第04週：Trading Strategies Involving Options
- 第05週：Binomial Trees
- 第06週：Wiener Processes and Ito's Lemma
- 第07週：The Black-Scholes-Merton Model
- 第08週：期中考試
- 第09週：Options on Stock Indices, Currencies and Futures
- 第10週：The Greek Letters
- 第11週：Volatility Smiles
- 第12週：Basic Numerical Procedures
- 第13週：Estimating Volatilities and Correlations
- 第14週：Credit Risk
- 第15週：Exotic Options
- 第16週：Interest Rate Derivatives
- 第17週：期末考試
- 第18週：檢討期末考試

成績及評量方式

- 隨堂測驗：15%
- 期中考：30%
- 課後作業：15%
- 期末考：40%

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

- 1.期貨與選擇權金鐵英、金鐵珊 合著新陸書局978-626-96567-0-72022第3版(教科書)

參考資料

本課程無參考資料!

建議先修課程

1.Investment

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~benzcalvert/>

E-Mail：benzcalvert@hotmail.com

Office Hour：

分機：

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。