

重新查詢

友善列印

0981學期 課程基本資料

系所 / 年級	財金系 4年級	課號 / 班別	86U00040 / A
學分數	3學分	選 / 必修	必修
科目中文名稱	衍生性金融商品	科目英文名稱	Derivatives
主要授課老師	林建志	開課期間	一學年之上學期
人數上限	60 人	已選人數	59人

起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M513 / 星期1第02節
第1週 / 第18週 / M513 / 星期1第03節
第1週 / 第18週 / M513 / 星期1第04節

請各位同學遵守智慧財產權觀念；請勿非法影印。

教學綱要

一、教學目標(Objective) 一、瞭解衍生性金融商品相關理論與交易實務。二、探討契學規格、理論價格決定方式。三、探討新金融商品套利策略建構方法。

二、先修科目(Pre Course) 無

三、教材內容(Outline) 一、衍生性商品概論。二、期貨導論。三、保證金制度。四、合理價格與交易策略。五、指數期貨。六、套利策略。七、選擇權。

四、教學方式(Teaching Method) 講授、研討。

五、參考書目(Reference) 期貨與選擇權－廖四郎、王昭文

1900/1/1 Introduction to Derivatives, including Forwards, Futures, Options, Swaps.
1900/1/1 Insurances, Collars, and Other Strategies.
1900/1/1 Introduction to Risk Management.
1900/1/1 Financial Forwards and Futures.
1900/1/1 The Wide Wrold of Futures Contracts.
1900/1/1 Interest Rate Forwards and Futures.
1900/1/1 Swaps

六、教學進

度(Syllabi)	1900/1/1	Mid-term Exam
	1900/1/1	Parity and other Option relationships.
	1900/1/1	Binomial Option Pricing.
	1900/1/1	The Black-Scholes Formula.
	1900/1/1	Financial Engineering and Security Design.
	1900/1/1	Corporate Applications
	1900/1/1	Real Options.
	1900/1/1	REITS
	1900/1/1	Final Exam.

七、評量方式(Evaluation) 1. 出席30% 2. 期中30% 3. 期末40%

八、講義位址(http://) [Power Points of Each Chapter](#)

九、教育目標

重新查詢