

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 / B
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	陳獻儀	開課期間	一學年之上學期
人數上限	60 人	已選人數	52人

起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M012 / 星期2第02節
第1週 / 第18週 / M012 / 星期2第04節
第1週 / 第18週 / M012 / 星期2第03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) 俾使修課同學對衍生性金融商品市場有所認識，初略認知各商品之評價模式，並進而能從事避險、投機與套利等交易策略交易。

二、先修科目(Pre Course) 財務管理

三、教材內容(Outline) This course is to provide students with a general understanding of the economic functions of financial derivatives including forward contracts, futures, options and swaps.

四、教學方式(Teaching Method) 講授、個案教學、媒體運用

五、參考書目(Reference) 課堂宣布

2009/9/15	Introduction	陳獻儀
2009/9/22	Futures Markets	陳獻儀
2009/9/29	Futures Prices	陳獻儀
2009/10/6	Using Futures Markets	陳獻儀
2009/10/13	Interest Rate Futures	陳獻儀
2009/10/20	Stock Index Futures	陳獻儀
2009/10/27	Foreign Currency Futures	陳獻儀
2009/11/3	The Options Market	陳獻儀

六、教學進度(Syllabi)	2009/11/10 Midterm Exam	陳獻儀
	2009/11/17 Option Payoffs and Option Strategies	陳獻儀
	2009/11/24 Bounds on Option Prices	陳獻儀
	2009/12/1 European Option Pricing	陳獻儀
	2009/12/8 Option Sensitivities and Option Hedging	陳獻儀
	2009/12/15 American Option Pricing	陳獻儀
	2009/12/22 Options on Stock Indexes, Foreign Currency, Interest Rate and Futures	陳獻儀
	2009/12/29 Exotic Options	陳獻儀
	2010/1/5 The Swaps Market	陳獻儀
	2010/1/12 Final Exam	陳獻儀

七、評量方式(Evaluation) Class Participation 30% Midterm Exam 35% Final Exam 35%

八、講義位址(<http://>)

九、教育目標

重新查詢