

重新查詢

友善列印

### 0982學期 課程基本資料

系所 / 年級	財金系 3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	一學年之下學期
人數上限	65 人	已選人數	64 人

### 起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / A004 / 星期2第03節  
第1週 / 第18週 / A004 / 星期2第04節  
第1週 / 第18週 / A004 / 星期2第98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、探討契約規格、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

2010/2/23	衍生性商品概論	林建志
2010/3/2	期貨導論	林建志
2010/3/9	期貨契約特色與保證金制度	林建志
2010/3/16	期貨合理價格與交易策略	林建志
2010/3/23	股價指數期貨	林建志
2010/3/30	交易所買賣基金-台灣50相關套利策略	林建志
2010/4/6	遠期利率協定與利率期貨	林建志
2010/4/13	外匯期貨	林建志

六、教學進度(Syllabi)	2010/4/20 期中考	林建志
	2010/4/27 選擇權概論	林建志
	2010/5/4 選擇權價格行爲	林建志
	2010/5/11 買賣權平價公式與其運用	林建志
	2010/5/18 Black&Scholes選擇權理論與應用	林建志
	2010/5/25 選擇權的交易策略	林建志
	2010/6/1 利率與外匯選擇權	林建志
	2010/6/8 Greek Letters 與其運用	林建志
	2010/6/15 交換	林建志
	2010/6/22 期末考	林建志

七、評量方式(Evaluation) 報告20% 小考20% 出席10% 期中考20% 期末考30%

八、講義位址(<http://>)

九、教育目標

重新查詢