

南台科技大學 99 學年度第 1 學期課程資訊

課程名稱	期貨與選擇權
課程編碼	80D03601
系所代碼	08
開課班級	二技財金四甲
開課教師	朱岳中
學分	3.0
時數	3
上課節次地點	二 5 6 7 教室 S404
必選修	選修
課程概述	This course is to introduce fundamental features of the futures and options contracts. Trading strategies that associate with hedging and pricing are also involved in this course.
課程目標	This course not only provides basic analysis under theoretically systematic framework, we also provide fruitful opportunities to induce students to work on assigned exercises periodically to get some tastes of the futures and options practically.
課程大綱	<ol style="list-style-type: none"> 1. 衍生性金融商品簡介 2. 期貨市場概況 3. 期貨價格之決定 4. 期貨之套利, 避險與投機操作策略 5. 股價指數, 利率期貨, 與外匯期貨 6. 選擇權市場概況 7. 選擇權之基本交易策略 8. 選擇權之定價模式 9. 股價指數, 外幣, 及期貨選擇權 10. 利率選擇權及非標準化利率交換合約
英文大綱	<ol style="list-style-type: none"> 1. Introduction to derivative instruments 2. Introduction to futures markets 3. Determinations of futures prices 4. Arbitraging, hedging and speculating strategies using futures 5. Index futures, interest rate futures, and foreign exchange rate futures 6. Introduction to options markets 7. Elementary options trading strategies 8. Options pricing formula 9. Options on stock indices, currencies and futures contracts 10. Options on interest rates and non-standardized interest rate swap
教學方式	課堂教授, 實務操作,

評量方法	自行設計測驗,實作評量,課程參與度(出席率),
指定用書	自編講義 (請由學校 Blackboard 網站自行下載)
參考書籍	1.Fundamentals of Futures and Options Markets (John C. Hull) 。 2.衍生性金融商品-選擇權、期貨與交換，(陳威光，智勝) 3.期貨與選擇權 (王淑芬，智勝)
先修科目	
教學資源	個人網站： http://tw.myblog.yahoo.com/invest-YCCHU
注意事項	
全程外語授課	0
授課語言 1	華語
授課語言 2	
輔導考照 1	
輔導考照 2	