

南臺科技大學 106 學年度第 2 學期課程資訊

課程代碼	80D03601
課程中文名稱	期貨與選擇權
課程英文名稱	Futures and Options
學分數	3.0
必選修	選修
開課班級	四技財金三甲 四技財金三乙四技財金三丙
任課教師	王慶昌
上課教室(時間)	週一第 7 節(S403) 週一第 8 節(S403) 週一第 9 節(S403)
課程時數	3
實習時數	0
授課語言 1	華語
授課語言 2	
輔導考照 1	
輔導考照 2	
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.
先修科目或預備能力	
課程學習目標與核心能力之對應	<p>※編號，中文課程學習目標，英文課程學習目標，對應系指標</p> <p>-----</p> <p>1.能了解期貨與選擇權的基本特徵與交易技巧，To be able to understand basic characteristics and trading skills of futures and options contracts，1 財務知識</p> <p>2.能分析期貨與選擇權市場的趨勢，To be able to analyze trend of futures and options markets，2 金融知識</p> <p>3.能使用期貨與選擇權知識管理證券投資組合，To be able to use knowledge of futures and options to manage security portfolios，3 財金實務</p> <p>4.能規劃與設計企業融資與避險方案，To be able to plan and design corporate financing and risk-hedging projects，6 辨識構思</p>
中文課程大綱	<p>1.衍生性金融商品簡介</p> <p>2.期貨市場概況</p> <p>3.期貨價格之決定</p> <p>4.期貨之套利,避險與投機操作策略</p> <p>5.股價指數, 利率期貨, 與外匯期貨</p> <p>6.選擇權市場概況</p>

	<p>7.選擇權之基本交易策略</p> <p>8.選擇權之定價模式</p> <p>9.股價指數, 外幣, 及期貨選擇權</p> <p>10.利率選擇權及非標準化利率交換合約</p>
英/日文課程大綱	<p>1.Introduction to derivative instruments</p> <p>2.Introduction to futures markets</p> <p>3.Determinations of futures prices</p> <p>4.Arbitraging, hedging and speculating strategies using futures</p> <p>5.Index futures, interest rate futures, and foreign exchange rate futures</p> <p>6.Introduction to options markets</p> <p>7.Elementary options trading strategies</p> <p>8.Options pricing formula</p> <p>9.Options on stock indices, currencies and futures contracts</p> <p>10.Options on interest rates and non-standardized interest rate swap</p>
課程進度表	<p>第 1~2 週 衍生性金融商品簡介</p> <p>第 3~4 週 期貨市場概況</p> <p>第 4~5 週 期貨價格之決定</p> <p>第 6~7 週 期貨之套利, 避險與投機操作策略</p> <p>第 8~10 週 股價指數, 利率期貨, 與外匯期貨</p> <p>第 11~12 週 選擇權市場概況</p> <p>第 13~14 週 選擇權之基本交易策略</p> <p>第 15~16 週 選擇權之定價模式</p> <p>第 16~17 週 股價指數, 外幣, 及期貨選擇權</p> <p>第 17~18 週 利率選擇權及非標準化利率交換合約</p>
教學方式與評量方法	<p>※課程學習目標, 教學方式, 評量方式</p> <p>-----</p> <p>能了解期貨與選擇權的基本特徵與交易技巧, 課堂講授, 日常表現筆試筆試</p> <p>能分析期貨與選擇權市場的趨勢, 課堂講授, 日常表現筆試筆試</p> <p>能使用期貨與選擇權知識管理證券投資組合, 課堂講授, 日常表現筆試筆試</p> <p>能規劃與設計企業融資與避險方案, 課堂講授, 日常表現筆試筆試</p>
指定用書	<p>書名: 自編教材</p> <p>作者:</p> <p>書局:</p> <p>年份:</p> <p>ISBN:</p> <p>版本:</p>
參考書籍	
教學軟體	

課程規範	
------	--