



《尊重智慧財產權，請使用正版教科書，勿非法影印書籍及教材，以免侵犯他人著作權》

開課班級: 進四企管三

授課老師: 伍珮瑄

學分數: 3

#### 課程大綱:

本課程規劃以衍生性金融商品之學理與實務探討為主軸，其中包括如何利用金融期貨商品進行避險、套利與投機活動。期使選修同學對衍生性商品的特性與操作有初步的認識。授課內容主要包：期貨市場介紹、期貨的交易策略、常見期貨商品(股價指數、股票與外匯期貨)、選擇權市場介紹、股價指數選擇權、認售(購)權證及其他衍生性與結構型商品的介紹等。

#### outline:

This course discusses the theory concept and technology of financial derivatives. The main issues discussing in this course are: concept and technology of hedge, arbitrage and speculation for options and futures. The course covers the following subjects: Options and Futures markets: history, quotations and characteristics; Options and Futures pricing and the binomial model; Pricing options using Black- Scholes model ; Pricing sensitivities; Hedging with options and Futures; Options and Futures strategies: speculation and spreading.

#### 教學型態:

課堂教學

#### 成績考核方式:

平時成績:40%

期中考:30%

期末考:30%

其它:%

#### 本科目教學目標:

一、本系旨在配合國家教育目標、經濟情勢變遷、工商企業發展及本校中長期發展計畫，以連貫的課程規劃對學生施以密集的專業訓練，並陶冶其職業道德及服務精神，培育企業管理技術人才，使學生能擔任與企業人力資源、行銷、財務、生產、資訊有關之計畫、執行、控制等管理工作。二、學習目標 知識：認識衍生性金融商品，了解期貨選擇權避險基本原理與交易策略。技能：熟悉期貨選擇權基本避險操作。態度：按時上課，準時繳交作業。

#### 參考書目:

上課用書：謝劍平，衍生性金融商品(最新版)，智勝文化。證照參考用書：金融研訓院，衍生性金融商品概論與實務。



## 課程進度表：

週次	起訖月日	授課單元(內容)	備註
第1週	2.20~2.27	課程介紹與要求、證照介紹。衍生性金融商品概述。	8日正式上課。8~12日課程加退選，轉學(系)生、復學生及延修生選課，雙主修、輔系申請，12日申辦抵免學分截止日
第2週	2.27~3.06	衍生性金融商品概論；認識期貨契約	
第3週	3.06~3.13	期貨市場；習題講解；證照題庫講解	28日(日)孔子誕辰紀念日/教師節(放假),29日(一)補假
第4週	3.13~3.20	期貨的交易策略；習題講解；證照題庫講解	29日成績優異提前畢業者提出申請截止日
第5週	3.20~3.27	股價指數期貨；習題講解	6日(一)中秋節(放假)，10日(五)國慶日(放假)
第6週	3.27~4.03	股票期貨；習題講解	14日學生宿舍安全輔導暨複合式防災疏散演練。18日多益測驗
第7週	4.03~4.10	專題演講(預定)	24日(五)補假，25日(六)光復暨古寧頭大捷日(放假)。
第8週	4.10~4.17	外匯期貨；習題講解；複習	30日校課程委員會
第9週	4.17~4.24	期中考試	3~9日期中考試
第10週	4.24~5.01	選擇權市場(1)；習題講解	13日教務會議,16日教師期中成績上網登錄截止日
第11週	5.01~5.08	選擇權市場(2)；習題講解	
第12週	5.08~5.15	選擇權交易策略；習題講解	24~28體育運動週。24日校園路跑。27日運動大會夜間開幕，28日運動大會活動，29日101週年校慶活動日，照常上班
第13週	5.15~5.22	專題演講(預定)	
第14週	5.22~5.29	認購(售)權證(1)；習題講解	12日申請停修課程截止日
第15週	5.29~6.05	認購(售)權證(2)；習題講解	
第16週	6.05~6.12	結構型金融商品	22日校務會議。25日行憲紀念日(放假)
第17週	6.12~6.19	氣候衍生性金融商品；複習	1日(四)開國紀念日(放假)
第18週	6.19~6.26	期末考試	5~11日期末考試，10~11日學生退宿