

## 開南大學 95 年度第 2 學期 財務金融 學系科目教學計劃表

課程編號	1 0 5 0 3 1 5 0 0	<input checked="" type="checkbox"/> 必修 <input type="checkbox"/> 選修	授課教師：吳柏成 開課系所：財務金融 年級班別：3 年	老師 學系 班		
班次	01,02					
課程名稱(中文)		學分數	課程名稱(英文)			
衍生性金融商品		3	Derivatives			
教學目標 與內容	本課程涵蓋大部分衍生性金融商品的相關主題，包括選擇權、期貨、金融交換及進階內容。課程避免使用過多數學式，以協助學生能很快地進入衍生性金融商品領域，並吸收其精華。同時，課程盡量以本土認購權證、台指期貨及選擇權或國外交易所之產品為實例，使學生能透過實際產品之描述，進而達到理論和實務相結合之目標。					
實施方法	<input checked="" type="checkbox"/> 講解法 <input type="checkbox"/> 實作法 <input checked="" type="checkbox"/> 討論法 <input checked="" type="checkbox"/> 演習法 <input type="checkbox"/> 問答法 <input checked="" type="checkbox"/> 其他（個案研究）					
評量方式	期中測驗 30%、期末測驗 30%、平時成績 40%					
授課使用及 參考書籍	(請按作者、書名、版別、出版商、發行地、出版年份、起訖頁數順序填寫)。 授課教材：陳威光，衍生性金融商品－選擇權・期貨與交換，智勝文化，2003。 參考資料：相關主題的文獻。					
科目簡介(可含大綱及教學進度)：						
<table border="0"> <tr> <td style="vertical-align: top;"> 1. 衍生性商品導論  2. 選擇權導論  3. 選擇權價格及價格上下限  4. 買權賣權等價理論  5. Black-Scholes 選擇權評價模型  6. 選擇權的交易策略  7. 股價指數選擇權與外匯選擇權  8. 台灣的認購權證市場  9. 遠期契約  10. 期貨導論 </td> <td style="vertical-align: top;"> 11. 期貨的評價  12. 期貨的交易策略  13. 股價指數期貨  14. 外匯期貨與利率期貨  15. 台灣的期貨市場  16. 交換契約導論  17. 交換的經濟含意、評價及其他交換契約  18. 新奇選擇權  19. 合成證券與財務工程  20. 選擇權進階主題 </td> </tr> </table>					1. 衍生性商品導論 2. 選擇權導論 3. 選擇權價格及價格上下限 4. 買權賣權等價理論 5. Black-Scholes 選擇權評價模型 6. 選擇權的交易策略 7. 股價指數選擇權與外匯選擇權 8. 台灣的認購權證市場 9. 遠期契約 10. 期貨導論	11. 期貨的評價 12. 期貨的交易策略 13. 股價指數期貨 14. 外匯期貨與利率期貨 15. 台灣的期貨市場 16. 交換契約導論 17. 交換的經濟含意、評價及其他交換契約 18. 新奇選擇權 19. 合成證券與財務工程 20. 選擇權進階主題
1. 衍生性商品導論 2. 選擇權導論 3. 選擇權價格及價格上下限 4. 買權賣權等價理論 5. Black-Scholes 選擇權評價模型 6. 選擇權的交易策略 7. 股價指數選擇權與外匯選擇權 8. 台灣的認購權證市場 9. 遠期契約 10. 期貨導論	11. 期貨的評價 12. 期貨的交易策略 13. 股價指數期貨 14. 外匯期貨與利率期貨 15. 台灣的期貨市場 16. 交換契約導論 17. 交換的經濟含意、評價及其他交換契約 18. 新奇選擇權 19. 合成證券與財務工程 20. 選擇權進階主題					
說明：						
3. 授課教師於學期前填寫本表，經課程委員會審核後，影印分送給教師所屬課程委員會召集人，授課班級所屬系、所及教務處課務組；並於開始上課時，將本內容向學生說明。						
4. 本表於 91.4.23 第四次校課程委員會討論通過。						

課程委員會召集人：

財金系主任 何文榮

授課教師：吳柏成

課務組  
96.3.13  
收文