國立台灣科技大學 114學年 第2學期 課程大綱

Spring 2026 NTUST Course Outline

授課教師：胡冠域,
繆維中

Instructor:HU KUAN YU,Miao, Wei-Chung

課程名稱：選擇權定價與策略

Course Title：Options Pricing and Strategies

2026/11/3

課程代號： MB2115701 Course Code 學分數： 3 Credits	必選修：選修/半學年 Required/Electve:Elective/Half Yr. 先修課程： Prerequisites
節次教室： Time/Location	W7(IB-305) W8(IB-305) W9(IB-305)
專業核心能力： Core Professional Competencies	■解決問題之能力(Problem Solving) ■管理專業知識(Comprehensive management knowledge)
課程網址： Course Website	
課程宗旨： Course Objectives	本課程介紹選擇權定價相關的數學模型，透過學理研討深化同學對選擇權合約中各項因子交互運作關係的了解，在此一基礎上，進一步探討選擇權各種操作策略的報酬與風險結構，並以實務作業引導同學進行實務操作，使所學知識能夠學以致用。 This course introduces the mathematical models for option pricing, giving students a deeper understanding of the interrelationships among various factors that influence option prices. Building on this foundation, the course further explores the return and risk structures of various option trading strategies. Practical assignments are also included to guide students in hands-on applications.
課程大綱： Outline of Lectures	1.選擇權概念簡介與復習(及與期貨之比較) 2.隨機漫步與二元樹的股價模型 3.布朗運動與幾何布朗運動 4.Black-Scholes選擇權定價公式5.選擇權價格的影響因子 6.隱含波動度與微笑曲線 7.選擇權的操作策略8.台灣選擇權市場的實務操作演練9.台灣權證市場的實務操作演練
授課方式： Method of Instruction	講授 Lecture：% 分組討論 Group discussion：% 案例研討 Case study：% 操做練習 Practical exercises：% 講授 Lecture：%
教科書： Textbooks	
參考書目： References	
修課須知： Notice	
評量方式： Grading	

備註說明：
Notes