

# 目錄 CONTENTS

推薦序 / ii

序 / iv

本書架構說明 / vi

本書學習導航 / viii

## 1

CHAPTER

認識衍生性金融商品 / 1

- |     |               |    |
|-----|---------------|----|
| 1.1 | 揭開衍生性金融商品的面紗  | 3  |
| 1.2 | 臺灣衍生性商品市場發展   | 11 |
| 1.3 | 期權大數據及金融科技的應用 | 15 |

## PART · 1 期貨市場

## 2

CHAPTER

期貨市場入門 / 29

- |     |             |    |
|-----|-------------|----|
| 2.1 | 期貨契約        | 30 |
| 2.2 | 期貨市場架構及專業術語 | 38 |

## 3

CHAPTER

現代期貨市場起源與發展 / 51

- |     |         |    |
|-----|---------|----|
| 3.1 | 期貨的種類   | 52 |
| 3.2 | 期貨交易所發展 | 56 |

## CONTENTS

<b>4</b> CHAPTER	傳統技術分析 —— K 線理論 / 73	
	4.1 技術分析	74
	4.2 傳統 K 線理論	78
	4.3 技術分析在期貨交易的運用	90
<b>5</b> CHAPTER	期貨交易策略 / 101	
	5.1 期貨價格的決定	103
	5.2 期貨的交易策略	116
<b>6</b> CHAPTER	期貨相關商品 —— 槓桿及反向型期貨 ETF / 137	
	6.1 ETF 起源與發展	140
	6.2 臺灣 ETF 市場	143
	6.3 槓桿及反向型 (期貨) ETF	155

## PART · 2 選擇權市場

<b>7</b> CHAPTER	選擇權的本質與價格特性 / 173	
	7.1 選擇權本質與發展	174
	7.2 選擇權交易與價格特性	187

## CONTENTS

8 CHAPTER	影響選擇權價格因素 / 203	
	8.1 認識選擇權評價模型	204
	8.2 選擇權的核心價值	214
9 CHAPTER	選擇權基本交易策略 / 231	
	9.1 選擇權單式策略	233
	9.2 選擇權交易的保證金	245
10 CHAPTER	複式交易策略 / 257	
	10.1 複式交易策略	258
	10.2 其他複式交易策略	275
11 CHAPTER	選擇權部位管理 —— Greeks / 293	
	11.1 敏感度分析	294
	11.2 選擇權的特性數據化	310
PART · 3 大數據與量化交易之運用		
12 CHAPTER	基礎量化交易概念 / 321	
	12.1 量化交易的架構與核心	322
	12.2 數據分析與程式化交易概念	334

## CONTENTS

<b>13</b> CHAPTER	建立期權數據資料庫 / 355	
	13.1 期權資料來源與蒐集	357
	13.2 臺指期貨與選擇權數據建置	365
<b>14</b> CHAPTER	期貨與選擇權量化應用 / 393	
	14.1 方向性量化指標應用	395
	14.2 波動率量化指標建置及運用	412
<b>15</b> CHAPTER	人工智慧概念 —— 期權數據實戰 / 429	
	15.1 人工智慧與機器學習	430
	15.2 運用數據智慧化交易	434
	索引 / 463	