

110學年度逢甲大學財務工程與精算學士學位學程

畢業專題成果發表心得分享

時間：110年12月17日(週五) 上午 9-12:00

地點：人言大樓第四國際會議廳

題目：選擇權的價格發現:賣權買權交易量比率

組員：黃嘉欣、陳心蘭、黃嘉欣、沈暉哲

指導老師：陳清和 教授

沈暉哲

透過這次的專題研究，從遠本對選擇權的一知半解，到稍有了解，知道大戶們通常都是如何用價差單去避開風險或減少投資成本，以及如何避免散戶們平時偏好的交易手法，股價報酬的預測需要考慮很多影響因子以及變數還有模型的假定，對於回歸分析沒有這麼熟悉的我們是一項大挑戰，也可知道我們能力不足以及可以再加強的部分，總而言之這次的成果發表收穫滿滿，謝謝老師的指導與同學的協助。

黃嘉欣

終於完成了這次期末專題報告，這是第一次與評審老師這麼近距離的報告，內心十分的緊張，製作報告當中遇到了些許困難，例如選擇權的文獻其實常多，整理文獻需要花費很多時間，以及之前大二大三學習了一些基本的程式語言，但是發現要實際運用在專題上，發現自己其實還有很大的學習空間，最後也感謝組員們的合作、教授的指導、兩位評審的改善建議與鼓勵。

陳心蘭

在這次製作畢業專題的過程中，學到了很多衍生性金融商品的相關知識，包括期貨與選擇權，對日後的實際操作有很大的幫助，但在這個過程中也發現自己有很多不足的地方，像是程式能力不足，或者是跑出來的結果跟我們本來所想像的不同，最後要感謝我的組員幫我補足了程式能力不足的缺點，還有指導老師的協助，讓我們順利完成這次的專題。

