

衍生性金融商品風險管理實務研討會 — 認股權證與外匯選擇權

-- 台北市證券商業同業公會 主辦

日期：一九九七年七月四日下午一時卅分至五時卅分

地點：台北國際會議中心一〇二室(台北市信義路五段一號)

研討會大綱

主持人：本會國際關係委員會委員暨中國國際商業銀行信託部經理
胡勝益先生

主講人：新加坡先進財務風險管理顧問公司劉治民先生(Mr. Ralph Liu)

- 1:30 — 1:40 主持人致詞並介紹主講人
- 1:40 — 2:40 主題一、管理市場風險的近來趨勢
- 冒險額的概念
 - 冒險額分析方法
 - 現金流量規劃
 - 衍生性產品的處理方法
- 2:40 — 2:50 休息
- 2:50 — 3:50 主題二、認股權證的定價及交易風險的管理
- 認股權證的基本介紹
 - 認股權證如何定價—以選擇權定價模型使用在認股權證
 - 選擇權內容之管理
 - 選擇權之避險
 - 國外選擇權實例介紹
- 3:50 — 4:00 休息
- 4:00 — 4:50 主題三、外匯選擇權之投資組合、交易、避險及市場形成
- 外匯選擇權的基本介紹
 - 外匯選擇權之交易及避險方法
 - 外匯選擇權之定價法
 - 外匯選擇權之市場形成
- 4:50 — 5:00 休息
- 5:00 — 5:30 問題與討論