



臺大管理論叢

NTU MANAGEMENT REVIEW

Special Issue
Call for Papers

衍生性商品市場與風險管理

Derivatives Markets and Risk Management

【專刊主題】

全球衍生性商品市場在經過幾十年的發展後，不管是交易量或商品種類都已達到相當大的規模，滿足了市場參與者各式各樣的交易需求。然而，在經過金融風暴的洗禮後，事實顯示市場參與者對於不斷推陳出新的衍生性商品特性的了解仍然相當有限，而且大部分投資者都在缺乏風險意識的狀況下進行交易。有鑑於此，臺大管理論叢擬邀請相關研究學者與專家，針對衍生性商品市場的資訊內涵、市場結構、投資人交易行為分析與其在風險管理的應用等議題，提出具有創意之理論與實證論文，期能增補過去衍生性商品市場與風險管理研究之不足，並能具體提供決策意涵。本次專刊的相關議題提示如下：

- 衍生性商品定價
- 衍生性商品市場微結構
- 衍生性商品之風險特性分析
- 衍生性商品之風險管理
- 金融風暴與衍生性商品市場
- 衍生性商品價格之資訊內涵
- 衍生性商品交易活動之資訊內涵
- 衍生性商品市場投資行為分析
- 波動率衡量與預測

為提高本專刊的論文品質，並鼓勵相關研究社群的形成與意見交流，我們將邀請初審後有機會被接受的論文，參與 2012 年 4 月 14 日(星期六)在臺大舉行的『臺大管理論叢專刊研討會』，透過與會者的評論與建議，提供具體修改意見。

【專刊主編】

張森林 國立臺灣大學財務金融學系暨研究所
周冠男 國立政治大學財務管理學系暨研究所
王耀輝 國立臺灣大學財務金融學系暨研究所

【徵稿簡約】

- 投稿文章請依本刊稿約之規定，評審程序亦依本刊審查之原則辦理。
- 投稿文章長度以二萬字為限，文稿請用 MS Word 處理，稿件格式請參考「臺大管理論叢稿約及格式說明」(<http://management.ntu.edu.tw/journal.htm>)。
- 來稿請寄電子檔至 review@management.ntu.edu.tw，主旨請標註：『論叢財務工程專刊_篇名』。

【重要時程】

- 截稿期限：2011 年 12 月 15 日
- 初審決定：2012 年 2 月 17 日
- 專刊研討會：2012 年 4 月 14 日 (六)
- 最後修改截稿：2012 年 5 月 31 日
- 結果公佈：2012 年 6 月 29 日