

目錄

一	前言	1
二	相關文獻回顧	2
三	理論介紹	9
3.1	買權-賣權平價式	9
3.2	買權-賣權-期貨平價式	10
3.3	箱型價差交易策略	11
四	檢定方法	13
4.1	買權-賣權平價式	13
4.2	買權-賣權-期貨平價式	15
4.3	箱型價差交易策略	16
五	資料來源與資料分析	17
5.1	資料來源	17
5.2	資料特性分析	18
六	實證結果與實證分析	25
6.1	成交價檢定實證結果	25
6.2	買賣價檢定實證結果	33
七	結論	38
	參考文獻	41