

國立臺灣大學管理學院財務金融學系

碩士論文

Graduate Institute of Finance

College of Management

National Taiwan University

Master Thesis

選擇權日內資訊與大盤報酬關係

The Relation between Intraday Implied Volatility Spreads
and Index Returns

姜奕帆

I - Fan Chiang

指導教授：莊文議 博士

Advisors: Wen-I Chuang, Ph.D

中華民國 108 年 6 月

June, 2019