

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

選擇權日內資訊對於大盤報酬之預測能力

Option Intraday Information On

Index Returns Predictability

姜奕帆

I-Fan Chiang

指導教授：王耀輝 博士

莊文議 博士

Advisors: Yaw-Huei Wang, Ph.D

Wen-I Chuang, Ph.D

中華民國 108 年 6 月

June, 2019