

淡江大學 106 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	期貨與選擇權	授課 教師	林允永 LIN YUN-YUNG
	FUTURES AND OPTIONS		
開課系級	財金三 B	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TLBXB3B		
系（ 所 ） 教 育 目 標			
配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。			
系（ 所 ） 核 心 能 力			
A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。 B. 加強相關金融法規的學習。 C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。 D. 提升學生的國際觀與外語能力。 E. 提升學生專業證照之能力。 F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。			
課程簡介	本課程主要在介紹衍生性商品市場及在市場中常見得金融工具(包括遠期、期貨、交換及選擇權)。 主要目的在讓學生了解衍生性商品市場概況，各種衍生性金融工具在金融市場的重要性及套利、投機和避險的應用。讓修課學生了解衍生性商品的基本原理與市場交易實務狀況，對未來進一步學習財務工程及金融商品提供紮實的基礎		
	The main purpose of this course is introduced the basic concept of the derivatives markets and the financial instruments used in this market. These instruments include the forwards, Futures, swaps and options. How to use these tools for arbitrage, speculative, and hedge is also an important object of this course. This course provides a solid basis for student to study financial engineering and new financial product.		

本課程教學目標與目標層級、系(所)核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、
C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、
P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、
A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系(所)核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應其「系(所)核心能力」。單項教學目標若對應「系(所)核心能力」有多項時，則可填列多項「系(所)核心能力」。
(例如：「系(所)核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列。)

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	系(所)核心能力
1	基本衍生性金融商品市場概念及交易實務	Basic idea of financial derivatives markets and trading activities	C3	AF

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	基本衍生性金融商品市場概念及交易實務	講述、討論	紙筆測驗、上課表現

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◆ 全球視野	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◇ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◇ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◇ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◆ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◇ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◇ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授 課 進 度 表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備 註
1	106/09/18~ 106/09/24	Chap 1 Introduction	
2	106/09/25~ 106/10/01	Chap 2 Mechanics of Futures Markets	
3	106/10/02~ 106/10/08	Chap 3 Hedging strategy using Futures	
4	106/10/09~ 106/10/15	Chap 4 Interest rates	
5	106/10/16~ 106/10/22	Chap 5 Determinants of Forwards and Futures	
6	106/10/23~ 106/10/29	Chap 6 Interest rates Futures	
7	106/10/30~ 106/11/05	Chap 7 Swaps	
8	106/11/06~ 106/11/12	Chap 9 Mechanics of Options markets	
9	106/11/13~ 106/11/19	Review	
10	106/11/20~ 106/11/26	期中考試週	
11	106/11/27~ 106/12/03	Chap 10 Properties of stock options	
12	106/12/04~ 106/12/10	Chap 11 Trading strategies involving options	

13	106/12/11~ 106/12/17	Chap 12 Introduction to Binomial trees	
14	106/12/18~ 106/12/24	Chap 13 Valuing stock options: The Black and Scholes Model	
15	106/12/25~ 106/12/31	Chap 17 Greeks	
16	107/01/01~ 107/01/07	開國紀念日(放假一天)	
17	107/01/08~ 107/01/14	Review	
18	107/01/15~ 107/01/21	期末考試週	
修課應 注意事項		修課同學請自行到教學支援平台下載教學投影片及補充資料	
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Fundamentals of Futures and Options Markets 8th edition by John Hull	
參考書籍			
批改作業 篇數		篇（本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫）	
學期成績 計算方式		◆出席率： 10.0 % ◆平時評量：20.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈 〉： %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」進入。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。	