

淡江大學 106 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	衍生性商品投資實務	授課 教師	賴冠吉 LAI KUAN-CHI
	DERIVATIVES:INVESTMENT PRACTICE		
開課系級	財金四 P	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXB4P		
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	介紹各項衍生性金融商品的定價模型、價格行為、商品特性、風險以及策略交易。透過理論與實務的結合，達到了解各項衍生金融商品的運用。		
	Introduce the Derivative Financial Products,including pricing model,price behavior, risk,and strategic trading. By way of theory and practice, approach the purpose of understanding financial derivatives.		

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	介紹各項衍生性金融商品的定價模型、價格行為、商品特性、風險以及策略交易。透過理論與實務的結合，達到了解各項衍生金融商品的運用。	Introduce the Derivative Financial Products,including pricing model,price behavior,risk,and strategic trading. By way of theory and practice, approach the purpose of understanding financial derivatives.	C3	ABCDE F

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	介紹各項衍生性金融商品的定價模型、價格行為、商品特性、風險以及策略交易。透過理論與實務的結合，達到了解各項衍生金融商品的運用。	講述、實作	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	衍生性金融商品發展歷史	
2	106/09/25~ 106/10/01	衍生性金融商品理論基礎(一)	
3	106/10/02~ 106/10/08	Warrant之定價、投資	
4	106/10/09~ 106/10/15	Warrant套利交易、策略交易	
5	106/10/16~ 106/10/22	期貨之各種交易策略與風險管理	
6	106/10/23~ 106/10/29	期貨與選擇權之造市機制與套利交易	
7	106/10/30~ 106/11/05	選擇權之各種交易策略、套利交易與風險管理	
8	106/11/06~ 106/11/12	外匯NDF、SWAP及選擇權交易與避險機制	
9	106/11/13~ 106/11/19	衍生性金融商品理論基礎(二)	
10	106/11/20~ 106/11/26	期中考試週	
11	106/11/27~ 106/12/03	轉換公司債之定價、投資	
12	106/12/04~ 106/12/10	轉換公司債套利交易與風險分析	

13	106/12/11~ 106/12/17	資產交換定價、投資	
14	106/12/18~ 106/12/24	資產交換交易策略與風險分析	
15	106/12/25~ 106/12/31	利率交換之投資、交易策略與風險分析	
16	107/01/01~ 107/01/07	利率選擇權之投資、交易策略與風險分析	
17	107/01/08~ 107/01/14	結構型商品之投資、交易策略與風險分析	
18	107/01/15~ 107/01/21	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Financial Derivatives, wilmott	
參考書籍		Options, Futures, and Other Derivatives (9th Edition)	
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： % ◆期中評量：40.0 % ◆期末評量：50.0 % ◆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。	