

淡江大學 106 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	期貨與選擇權	授課 教師	段昌文 CHANG-WEN DUAN
	FUTURES AND OPTIONS		
開課系級	財金一碩專班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
系（ 所 ） 教 育 目 標			
提供財務金融產業人才之專業訓練課程，以落實實務與理論融合應用之能力。			
系（ 所 ） 核 心 能 力			
A. 具備理論與實務融合應用之能力。 B. 具備個案研究與分析的能力。 C. 培養具備企業財務決策與分析之能力。 D. 發展專業競爭的能力與態度。 E. 提升財金研究理論與方法之素養。 F. 提升考取高階財金專業證照之能力。			
課程簡介	介紹期貨與選擇權市場與衍生商品，進而瞭解這些商品的特殊交易方式與商品特性，教學目標主要在訓練在職碩士班學生具有衍生性商品的交易概念與定價的能力，並培養具有寫作能力、問題解決技巧與臨場報告的期貨與選擇權人才。PS:本課程主要焦點在市場面與實務面，不牽涉繁雜的計算！		
	The objective of course is to understand the practice of pricing and hedging derivative securities accessible to EMBA students, as well as practitioners. Our teaching objectives, mainly in training students to the concept of trading and pricing for derivatives capabilities and train a writing skills, and making a presentation. Our courses focus will be on financial institutions, not in the calculation.		

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	衍生性商品在金融機構的交易與其定價	Trading and Pricing of Derivative on Financial Institution	C2	BDE

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	衍生性商品在金融機構的交易與其定價	講述、賞析	報告、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	107/02/26~ 107/03/04	課程簡介	
2	107/03/05~ 107/03/11	介紹衍生性金融商品與市場	
3	107/03/12~ 107/03/18	透過知名電影看衍生商品在全球金融體系的地位	
4	107/03/19~ 107/03/25	從美國貨幣看期貨(影片互動教學)	
5	107/03/26~ 107/04/01	美國金融機構發展與介紹(部分時間影片教學)	
6	107/04/02~ 107/04/08	從美國金融史看台灣金融機構發展(影片教學)	本週學校放假
7	107/04/09~ 107/04/15	4/15(日)下午於台北校園中正紀念堂D221參加2018第15屆兩岸金融市場發展研討會	
8	107/04/16~ 107/04/22	美國期貨市場介紹	
9	107/04/23~ 107/04/29	從美國期貨市場看台灣期貨市場發展+人工盤介紹	
10	107/04/30~ 107/05/06	5/5(六)下午於台北校園中正紀念堂D222參加2018年台商鮭魚返鄉財經論壇	期中考週
11	107/05/07~ 107/05/13	期貨交易策略簡介	
12	107/05/14~ 107/05/20	全球選擇權市場介紹 I(本週參加校本部研討會)	

13	107/05/21~ 107/05/27	全球選擇權市場介紹 II+台灣選擇權市場（含權證）簡介	
14	107/05/28~ 107/06/03	有關於衍生商品交易員之簡介(影片互動教學)	
15	107/06/04~ 107/06/10	選擇權交易策略介紹+選擇權的Case Study	
16	107/06/11~ 107/06/17	Multicharts程式交易介紹	
17	107/06/18~ 107/06/24	回顧台灣的期貨市場	
18	107/06/25~ 107/07/01	期末考試週	
修課應 注意事項	1.本課程期中與期末考試週繳交撰寫上課心得報告各A4 page 1~2。 2.本課程內容焦點在"金融機構"與"實務市場"，不牽涉"計算"面！ 3.上課方式有40%時間透過"金融"與"期貨"影片互動教學，同學可就這些撰寫報告！		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	期貨與選擇權（謝劍平）－出版社：智勝 / PS：上課發講義教學		
參考書籍			
批改作業 篇數	2 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： 30.0 % ◆平時評量：10.0 % ◆期中評量： % ◆期末評量： % ◆其他〈上課心得報告(期中+期末)〉：60.0 %		
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。		