

淡江大學 108 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	實體課程 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。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。(比重：35.00)</p> <p>B. 加強相關金融法規的學習。(比重：10.00)</p> <p>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。(比重：10.00)</p> <p>D. 提升學生的國際觀與外語能力。(比重：10.00)</p> <p>E. 提升學生專業證照之能力。(比重：20.00)</p> <p>F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。(比重：15.00)</p>			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
<p>1. 全球視野。(比重：15.00)</p> <p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>3. 洞悉未來。(比重：15.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：50.00)</p>			
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.		

本課程教學目標與認知、情意、技能目標之對應

將課程教學目標分別對應「認知 (Cognitive)」、「情意 (Affective)」與「技能(Psychomotor)」的各目標類型。

- 一、認知(Cognitive)：著重在該科目的事實、概念、程序、後設認知等各類知識之學習。
- 二、情意(Affective)：著重在該科目的興趣、倫理、態度、信念、價值觀等之學習。
- 三、技能(Psychomotor)：著重在該科目的肢體動作或技術操作之學習。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)
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.
2	讓學生學習各種衍生性商品基本理論，透過市場實際資料，說明實務上如何操作交易各種衍生性商品。	Learn the basic theories of derivatives, how to use the market information to trade the derivatives in market.

教學目標之目標類型、核心能力、基本素養教學方法與評量方式

序號	目標類型	院、系(所)核心能力	校級基本素養	教學方法	評量方式
1	認知	ABCDEF	1235	講述、模擬	測驗
2	技能	ABCDEF	1235	講述、模擬	測驗

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	108/09/09~ 108/09/15	衍生性金融商品發展歷史	
2	108/09/16~ 108/09/22	衍生性金融商品理論基礎(一)	
3	108/09/23~ 108/09/29	Warrant之定價、投資	
4	108/09/30~ 108/10/06	Warrant套利交易、策略交易	
5	108/10/07~ 108/10/13	期貨之各種交易策略與風險管理	
6	108/10/14~ 108/10/20	期貨與選擇權之造市機制與套利交易	
7	108/10/21~ 108/10/27	選擇權之各種交易策略、套利交易與風險管理	
8	108/10/28~ 108/11/03	外匯NDF、SWAP及選擇權交易與避險機制	
9	108/11/04~ 108/11/10	衍生性金融商品理論基礎(二)	
10	108/11/11~ 108/11/17	期中考試週	
11	108/11/18~ 108/11/24	轉換公司債之定價、投資	

12	108/11/25~ 108/12/01	轉換公司債套利交易與風險分析	
13	108/12/02~ 108/12/08	資產交換定價、投資	
14	108/12/09~ 108/12/15	資產交換交易策略與風險分析	
15	108/12/16~ 108/12/22	利率交換之投資、交易策略與風險分析	
16	108/12/23~ 108/12/29	利率選擇權之投資、交易策略與風險分析	
17	108/12/30~ 109/01/05	結構型商品之投資、交易策略與風險分析	
18	109/01/06~ 109/01/12	期末考試週(本學期期末考試日期為:109/1/3-109/1/9)	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教科書與 教材	Financial Derivatives, wilmott		
參考文獻	Options, Futures, and Other Derivatives (10th 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： https://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」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。		