

淡江大學 108 學年度第 2 學期課程教學計畫表

|                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------------|
| 課程名稱                                                                                        | 衍生性金融商品                                                                                                                                                                                                                                                      | 授課<br>教師 | 黃健銘<br>HUANG,<br>CHIEN-MING |
|                                                                                             | INTRODUCTION TO DERIVATIVES                                                                                                                                                                                                                                  |          |                             |
| 開課系級                                                                                        | 數商經濟碩一 A                                                                                                                                                                                                                                                     | 開課<br>資料 | 實體課程<br>選修 單學期 2學分          |
|                                                                                             | TLVXM1A                                                                                                                                                                                                                                                      |          |                             |
| 系（ 所 ） 教 育 目 標                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
| 本學程旨在整合經濟、產業分析、金融管理與數位商務等跨領域的課程內容，訓練學生分析市場資訊、規劃市場策略、科技創新與數位行銷等核心能力，以因應數位電子商務快速發展，培養所需之專業人才。 |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
| 本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
| A. 具應用程式撰寫之能力。(比重：30.00)<br>C. 具金融分析之能力。(比重：40.00)<br>D. 具金融科技之知識。(比重：30.00)                |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
| 本課程對應校級基本素養之項目與比重                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
| 2. 資訊運用。(比重：30.00)<br>3. 洞悉未來。(比重：40.00)<br>5. 獨立思考。(比重：30.00)                              |                                                                                                                                                                                                                                                              |          |                             |
| 課程簡介                                                                                        | 本課程在介紹投資管理的過程，使學生了解投資學上許多理論，並能充分利用，包括交易策略、期貨市場與選擇權市場的定價與套利及衍生性金融商品的角色。                                                                                                                                                                                       |          |                             |
|                                                                                             | This course aims to introduce the investment management process to help students understand theory and practice. It includes the following topics:trading strategies, pricing and arbitrage of futures and options commodities, and the role of 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  | 本課程有助學生瞭解金融衍生性理論。 | This course helps students to understand financial derivatives theory |

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   | ACD        | 235    | 講述、討論 | 測驗、作業、報告(含口頭、書面) |

授課進度表

| 週次 | 日期起訖                    | 內 容 (Subject/Topics)   | 備註      |
|----|-------------------------|------------------------|---------|
| 1  | 109/03/02~<br>109/03/08 | 課程介紹與評分方式              |         |
| 2  | 109/03/09~<br>109/03/15 | 集中市場與商品範疇              |         |
| 3  | 109/03/16~<br>109/03/22 | 資本市場與交易制度              |         |
| 4  | 109/03/23~<br>109/03/29 | 衍生性商品實務(一)             | 期貨      |
| 5  | 109/03/30~<br>109/04/05 | 衍生性商品實務(二)             | 指數股票型基金 |
| 6  | 109/04/06~<br>109/04/12 | 衍生性商品資料分析與處理(一)        |         |
| 7  | 109/04/13~<br>109/04/19 | 衍生性商品資料分析與處理(二)與美國存託憑證 |         |
| 8  | 109/04/20~<br>109/04/26 | 期中報告(一)                |         |
| 9  | 109/04/27~<br>109/05/03 | 期中報告(二)                |         |
| 10 | 109/05/04~<br>109/05/10 | 期貨商品定價理論               |         |
| 11 | 109/05/11~<br>109/05/17 | 選擇權定價理論                |         |
| 12 | 109/05/18~<br>109/05/24 | 文章導讀(一)                |         |
| 13 | 109/05/25~<br>109/05/31 | 文章導讀(二)                |         |
| 14 | 109/06/01~<br>109/06/07 | 書報討論(一)                |         |

|              |                         |                                                                                                                                                                            |  |
|--------------|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 15           | 109/06/08~<br>109/06/14 | 文章報告討論(一)                                                                                                                                                                  |  |
| 16           | 109/06/15~<br>109/06/21 | 文章報告討論(二)                                                                                                                                                                  |  |
| 17           | 109/06/22~<br>109/06/28 | 文章報告討論(三)                                                                                                                                                                  |  |
| 18           | 109/06/29~<br>109/07/05 | 教師彈性補充教學                                                                                                                                                                   |  |
| 修課應<br>注意事項  |                         | 請尊重智慧財產權，勿非法拷貝書籍。                                                                                                                                                          |  |
| 教學設備         |                         | 電腦、投影機                                                                                                                                                                     |  |
| 教科書與<br>教材   |                         | Hull, John C., Options, Futures, and Other Derivatives 9/E 2018 (Global Edition)                                                                                           |  |
| 參考文獻         |                         | 林蒼祥,蔡時銓,孫效孔,邱文昌著, 2010年, 期貨與選擇權, 前程文化。                                                                                                                                     |  |
| 批改作業<br>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<br>計算方式 |                         | ◆出席率： 20.0 %    ◆平時評量：        %    ◆期中評量：40.0 %<br>◆期末評量：40.0 %<br>◆其他〈 〉：        %                                                                                        |  |
| 備 考          |                         | 「教學計畫表管理系統」網址： <a href="https://info.ais.tku.edu.tw/csp">https://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處<br>首頁→教務資訊「教學計畫表管理系統」進入。<br><b>※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。</b> |  |