

淡江大學 109 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	林建志 LIN, CHIEN-CHIN
	FUTURES AND OPTIONS		
開課系級	財金一碩專班 A	開課 資料	實體課程 選修 單學期 3學分
	TLBXJ1A		
課程與SDGs 關聯性	SDG4 優質教育 SDG8 尊嚴就業與經濟發展		
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。			
本課程對應院、系(所)核心能力之項目與比重			
<p>A. 具備理論與實務融合應用之能力。(比重：50.00)</p> <p>B. 具備個案研究與分析的能力。(比重：10.00)</p> <p>E. 提升財金研究理論與方法之素養。(比重：20.00)</p> <p>F. 提升考取高階財金專業證照之能力。(比重：20.00)</p>			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
<p>2. 資訊運用。(比重：20.00)</p> <p>4. 品德倫理。(比重：20.00)</p> <p>5. 獨立思考。(比重：60.00)</p>			
課程簡介	<p>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。</p>		
	<p>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.</p>		

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	衍生性商品交易與定價	Trading and Pricing of Derivatives

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	ABEF	245	講述、討論	測驗

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	110/02/22~ 110/02/28	Introduction	
2	110/03/01~ 110/03/07	Mechanics of Futures Markets	
3	110/03/08~ 110/03/14	Hedging Strategies Using Futures	
4	110/03/15~ 110/03/21	Interest Rates	
5	110/03/22~ 110/03/28	Determination of Forward and Futures Prices	
6	110/03/29~ 110/04/04	Swaps	
7	110/04/05~ 110/04/11	Mechanics of Options Markets	
8	110/04/12~ 110/04/18	Properties of Stock Options	
9	110/04/19~ 110/04/25	Trading Strategies Involving Options	
10	110/04/26~ 110/05/02	Mid-term exam	
11	110/05/03~ 110/05/09	Introduction to Binomial Trees	
12	110/05/10~ 110/05/16	Valuing Stock Options: The Black-Scholes-Merton Model	
13	110/05/17~ 110/05/23	The Greek Letters	
14	110/05/24~ 110/05/30	Binomial Trees in Practice	

15	110/05/31~ 110/06/06	Volatility Smiles	
16	110/06/07~ 110/06/13	Value at Risk	
17	110/06/14~ 110/06/20	Credit Derivatives	
18	110/06/21~ 110/06/27	Final exam	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦	
教科書與 教材		Fundamentals of Futures and Options Markets-John Hull	
參考文獻			
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：30.0 % ◆期末評量：40.0 % ◆其他〈課堂討論〉：20.0 %	
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。	