

淡江大學 1 1 1 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		
課程與SDGs 關聯性	SDG1 消除貧窮 SDG3 良好健康和福祉 SDG4 優質教育 SDG8 尊嚴就業與經濟發展		
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			
A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。(比重：35.00) B. 加強相關金融法規的學習。(比重：10.00) C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。(比重：10.00) D. 提升學生的國際觀與外語能力。(比重：10.00) E. 提升學生專業證照之能力。(比重：20.00) F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。(比重：15.00)			
本課程對應校級基本素養之項目與比重			
1. 全球視野。(比重：15.00) 2. 資訊運用。(比重：20.00) 3. 洞悉未來。(比重：15.00) 4. 品德倫理。(比重：5.00) 5. 獨立思考。(比重：30.00) 6. 樂活健康。(比重：5.00) 7. 團隊合作。(比重：5.00) 8. 美學涵養。(比重：5.00)			
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	12345678	講述、模擬	測驗
2	技能	ABCDEF	12345678	講述、模擬	測驗

授課進度表

週次	日期起訖	內 容 (Subject/Topics)	備註
1	111/09/05~ 111/09/11	衍生性金融商品發展歷史	
2	111/09/12~ 111/09/18	衍生性金融商品理論基礎(一)	
3	111/09/19~ 111/09/25	Warrant之定價、投資	
4	111/09/26~ 111/10/02	Warrant套利交易、策略交易	
5	111/10/03~ 111/10/09	期貨之各種交易策略與風險管理	
6	111/10/10~ 111/10/16	期貨與選擇權之造市機制與套利交易	
7	111/10/17~ 111/10/23	選擇權之各種交易策略、套利交易與風險管理	
8	111/10/24~ 111/10/30	外匯實務報價、換匯、Forward交易機制	

9	111/10/31~ 111/11/06	外匯NDF、SWAP及選擇權交易與避險機制	
10	111/11/07~ 111/11/13	期中考試週	
11	111/11/14~ 111/11/20	轉換公司債之投資	
12	111/11/21~ 111/11/27	轉換公司債套利交易與風險分析	
13	111/11/28~ 111/12/04	資產交換定價、投資	
14	111/12/05~ 111/12/11	資產交換交易策略與風險分析	
15	111/12/12~ 111/12/18	利率交換之投資、交易策略與風險分析	
16	111/12/19~ 111/12/25	利率選擇權之投資、交易策略與風險分析	
17	111/12/26~ 112/01/01	結構型商品之投資、交易策略	
18	112/01/02~ 112/01/08	期末考試週(本學期期末考試日期為:112/1/3-112/1/9)	
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 投資學, 『邱文昌、賴冠吉、李美杏、余曉靜、陳育欣』 著, 全華圖書	
參考文獻		Options, Futures, and Other Derivatives (11th Edition) John C. Hull	
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：45.0 % ◆期末評量：45.0 % ◆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。	